МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
"Казанский (Приволжский) федеральный университет"
Центр бакалавриата Экономика

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по образовательной деятельности КФУ
Проф. Д.А. Таюрский
_____ «___»_____20__г.

подписано электронно-цифровой подписью

Программа дисциплины

Риски в оценочной деятельности Б1.В.ДВ.15

Направление подготовки: 38.03.01 - Экономика
Профиль подготовки: не предусмотрено
Квалификация выпускника: бакалавр
Форма обучения: очное
Язык обучения: русский

Автор(ы):

Сафиуллин А.Р. , Хайруллина А.Д. , Девятков Тимур Владимирович

Рецензент(ы):

Якупова Н.М.

СОГЛАСОВАНО:

Заведующий(ая) кафедрой: Сафиуллин А. Р.
Протокол заседания кафедры No ___ от "____" _____ 201__г

Учебно-методическая комиссия Института управления, экономики и финансов (центр бакалавриата: экономика):
Протокол заседания УМК No ____ от "____" _____ 201__г

Регистрационный No 950097819

Содержание

1. Цели освоения дисциплины
2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы
3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля
4. Структура и содержание дисциплины/ модуля
5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения
6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов
7. Литература
8. Интернет-ресурсы
9. Материально-техническое обеспечение дисциплины/модуля согласно утвержденному учебному плану

ЭЛЕКТРОННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА КФУ

Программу дисциплины разработал(а)(и) профессор, д.н. (доцент) Сафиуллин А.Р. кафедра проектного менеджмента и оценки бизнеса Высшая школа Открытый институт инновационного, технологического и социального развития , safiullin.ar@gmail.com ; доцент, к.н. (доцент) Хайруллина А.Д. кафедра общего менеджмента Институт управления, экономики и финансов , halbi@mail.ru ; Девятков Тимур Владимирович

1. Цели освоения дисциплины

Целью изучения дисциплины выступает устойчивое овладение студентами базовыми понятиями и концепциями диагностики и моделирования рисков, а также принципами и методами исследования рисков в оценочной деятельности в целях принятия обоснованных управленческих решений. В ходе изучения дисциплины студенты должны получить знания в области методологии построения и применения экономико-математических моделей анализа и оценки рисков, а также системные представления об основах управления рисками в оценочной деятельности, используя современное программное обеспечение для решения задач моделирования подобного рода рисков.

2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы высшего профессионального образования

Данная учебная дисциплина включена в раздел Б1.В.ДВ.28.4 профессионального цикла дисциплин и относится к вариативной части, определяемой ООП вуза. Дисциплина осваивается на четвертом курсе очной формы обучения с нормативным сроком обучения (7 семестр).

3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля

В результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции:

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ПК-1 (профессиональные компетенции)	способностью собрать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов
ПК-2 (профессиональные компетенции)	способностью на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов
ПК-4 (профессиональные компетенции)	способностью на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты
ПК-5 (профессиональные компетенции)	способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений
ПК-8 (профессиональные компетенции)	способностью использовать для решения аналитических и исследовательских задач современные технические средства и информационные технологии

ЭЛЕКТРОННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА КФУ

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ОК-3 (общекультурные компетенции)	способностью использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности
ОПК-2 (профессиональные компетенции)	способностью осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач
ОПК-3 (профессиональные компетенции)	способностью выбрать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, проанализировать результаты расчетов и обосновать полученные выводы
ПК-11 (профессиональные компетенции)	способностью критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий

В результате освоения дисциплины студент:

1. должен знать:

- категориальный аппарат, базовые концепции, основные понятия, терминологию и инструментарий анализа и оценки рисков;
- состав, экономическое содержание, алгоритмы расчета и взаимосвязь основных видов рисков в оценочной деятельности;
- концептуальные основы и основные элементы экономико-математических моделей анализа и оценки рисков;
- основные элементы и этапы моделирования рисков;
- особенности применения математических методов и модели в теории управления рисками.

2. должен уметь:

- формулировать цель и задачи моделирования рисков в оценочной деятельности;
- применять современный математический инструментарий для анализа и оценки рисков;
- осуществлять отбор инструментальных средств обработки экономических данных, анализировать и использовать полученные результаты в обосновании решений в области диагностики и моделирования рисков;
- формализовать экономико- математическую модель оценки различных видов рисков в оценочной деятельности;
- формировать и интерпретировать полученные результаты моделирования рисков в оценочной деятельности;
- использовать современное программное обеспечение для решения экономических задач оценки рисков;

3. должен владеть:

- базовой терминологией современных методологических подходов анализа и оценки рисков,
- методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных для моделирования рисков в оценочной деятельности;
- базовыми практическими навыками сравнительного анализа и применимости методов оценки рисков;
- практическими навыками в области осуществления экономических расчетов при моделировании рисков с оценочной деятельности;

ЭЛЕКТРОННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА КФУ

- базовыми приемами и технологиями моделирования рисковых ситуаций в условиях недостаточности информации, неопределенности и трудно формализуемых задач.

4. должен демонстрировать способность и готовность:

- оперировать базовыми концепциями анализа и оценки рисков;

- на основе владения методологией анализа и оценки рисков осуществлять их моделирование в соответствии с изученными методиками;

- критически анализировать результаты моделирования рисков, гибко корректируя отдельные ее параметры для их оптимизации с целью принятия эффективных управленческих решений.

4. Структура и содержание дисциплины/ модуля

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетных(ые) единиц(ы) 108 часа(ов).

Форма промежуточного контроля дисциплины: зачет в 6 семестре.

Суммарно по дисциплине можно получить 100 баллов, из них текущая работа оценивается в 50 баллов, итоговая форма контроля - в 50 баллов. Минимальное количество для допуска к зачету 28 баллов.

86 баллов и более - "отлично" (отл.);

71-85 баллов - "хорошо" (хор.);

55-70 баллов - "удовлетворительно" (удов.);

54 балла и менее - "неудовлетворительно" (неуд.).

4.1 Структура и содержание аудиторной работы по дисциплине/ модулю

Тематический план дисциплины/модуля

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
1.	Тема 1. Сущность и содержание риска как экономической категории	6		2	2	0	Презентация Реферат Устный опрос
2.	Тема 2. Содержание риск-менеджмента в организации	6		2	2	0	Устный опрос Реферат Презентация
3.	Тема 3. Методы выявления и анализа рисков	6		4	4	0	Письменная работа Устный опрос Реферат
5.	Тема 5. Выбор рациональной стратегии в условиях неопределенности и рисков	6		4	4	0	Устный опрос Письменная работа

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практи-ческие занятия	Лабора-торные работы	
6.	Тема 6. Измерители и показатели рисков в оценочной деятельности	6		6	6	0	Устный опрос Реферат Презентация
9.	Тема 9. Портфельный подход к оценке рисков	6		4	6	0	Творческое задание Устный опрос
10.	Тема 10. Экспертные методы оценки рисков	6		4	4	0	Реферат Презентация
.	Тема . Итоговая форма контроля	6		0	0	0	Зачет
	Итого			26	28	0	

4.2 Содержание дисциплины

Тема 1. Сущность и содержание риска как экономической категории

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Содержание темы: Определение сущности рисков. Причины возникновения рисков. Объективное и субъективное понимание природы рисков. Эволюция взглядов на категорию ?риск? в зарубежной и отечественной науке и практике. Особенности категорий ?риск? и ?неопределенность?. Систематизация рисков, важные критерии классификации рисков.

практическое занятие (2 часа(ов)):

Контрольные вопросы: 1. Что такое риск, экономический риск? Назовите основные причины возникновения рисков. 2. Какие точки зрения существуют относительно сущности понятий ?риск? и ?неопределенность?? Чем они отличаются? В чем специфика информационного подхода к разделению этих понятий? 3. В чем состоит объективное и субъективное понимание природы риска? 4. Востребована ли практикой сегодня теоретическая проработка вопросов управления рисками организаций? 5. Чем отличаются классическая и неоклассическая теории финансов в вопросе количественной оценки рисков? 6. Какие факторы влияют на профиль экономических рисков организации? 7. Как следует проводить классификацию рисков в организации? 8. Назовите наиболее важные критерии классификации рисков и различные группы рисков в соответствии с данными критериями.

Тема 2. Содержание риск-менеджмента в организации

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Содержание темы: Развитие концепции управления рисками в экономической науке и практике. Цели, задачи, принципы, внешние и внутренние ограничения системы управления рисками в организации. Риск-менеджмент как система. Процесс управления рисками: сущность и характеристика этапов. Аутсорсинг в управлении рисками. Методы воздействия на экономические риски: диверсификация, отказ, разделение, резервирование, самострахование, лимитирование, страхование, хеджирование. Общая характеристика информации, необходимой для управления рисками. Правовые аспекты управления рисками в организации.

практическое занятие (2 часа(ов)):

ЭЛЕКТРОННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА КФУ

Контрольные вопросы: 1. Что такое управление рисками? Дайте определение ?риск-менеджменту? в широком и узком понимании. 2. Как развивалась концепция управления рисками в мировой науке? 3. Укажите особенности развития риск-менеджмента в РФ. 4. Укажите цели и задачи риск-менеджмента в организации. 5. Каковы основные принципы управления рисками? 6. Как связаны система управления рисками и стратегия развития организации? 7. В чем состоят особенности и специфика системы управления рисками в различных сферах предпринимательства? 8. Охарактеризуйте процесс управления рисками как динамический процесс. Какие этапы можно выделить в составе процесса управления рисками? В чем состоит суть каждого из этих этапов? 9. Перечислите и охарактеризуйте внутренние и внешние источники информации, используемые для целей управления рисками. 10. Какие методы воздействия на риск Вам известны? В каких случаях их целесообразно использовать? 11. Что такое ?аутсорсинг? в управлении рисками? 12. Какой может быть структура службы риск-менеджмента в нефинансовой компании?

Тема 3. Методы выявления и анализа рисков

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Содержание темы: Содержание методов выявления рисков: опросные листы, структурные диаграммы, карты потоков, инспекции, анализ финансовой и управленческой отчетности. Методы идентификации рисков: качественный и количественный анализ рисков. Статистический и вероятностный подход в количественной оценке ожидаемой доходности и уровня рисков финансовых активов: используемые количественные показатели. Сравнительная оценка вариантов управленческих решений с учетом риска. Зональный метод оценки рисков и эмпирическая шкала уровня рисков: область допустимого, критического, катастрофического рисков. Использованием дерева решений в риск-менеджменте.

практическое занятие (4 часа(ов)):

ЭЛЕКТРОННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА КФУ

Контрольные вопросы: 1. Для чего применяются в риск-менеджменте опросные листы и какую информацию они содержат? 2. Укажите назначение карты потоков в риск-менеджменте и информацию, которая в ней отражается? 3. В чем суть запланированных и незапланированных инспекций в управлении рисками? 4. Какая отчетность организации и какая информация из нее используются при оценке экономических рисков организации? 5. Что выполняется на этапе качественной оценки рисков? 6. Какие методы оценки вероятности неблагоприятных событий Вам известны? 7. Какие количественные показатели общего риска актива Вам известны и как они вычисляются? Какой из них наиболее предпочтителен? 8. Как вычисляется ожидаемая доходность финансового актива и фондового портфеля? 9. Как связаны между собой: ожидаемая, номинальная и реальная доходности финансовых активов и фондовых портфелей? 10. Как вычисляются количественные показатели общего риска финансового актива в случае статистического и вероятностного подходов? 11. Какая методика может быть использована при сравнительной оценке и выборе наиболее предпочтительного актива при анализе уровня риска и ожидаемой доходности, в случае, когда у одного актива ? риск выше, но и ожидаемая доходность тоже выше? Практические задания: 1. Статистические данные по фактической доходности двух видов ценных бумаг за четыре последних квартала представлены в таблице 1. Таблица 1 Данные о фактических доходностях финансовых активов Номер временного периода Доходность ФА ?А? (в % годовых) Доходность ФА ?Б? (в % годовых) 1 10 14 2 13 11 3 16 12 4 9 8 Оцените количественно ожидаемую доходность и уровень общего риска каждого финансового актива, используя все три количественных показателя уровня риска. Сделайте вывод о том, какой актив предпочтительнее? 2. В таблице 2 представлены данные по возможным значениям ожидаемой доходности каждого из активов и соответствующие им вероятности. Вычислите ожидаемую доходность и оцените риск для акции А и акции Б при помощи показателей дисперсии, стандартного отклонения и коэффициента вариации доходности. Сделайте вывод о том, какой актив предпочтительнее? Таблица 2 Данные о возможных значениях доходностей акций Номер по порядку Возм. значения доходности акции А Вероятность события Возм. значения доходности акции Б Вероятность события 1 17 0,3 18 0,3 2 9 0,3 10 0,3 3 5 0,3 2 0,2 4 -2 0,1 -1 0,2 3. Автомобильный завод получает деталь ?реле сигнала поворота? от двух поставщиков: А и Б. Качество этих изделий характеризуется данными, приведенными в таблице 3. Полные затраты, связанные с ремонтом одного бракованного реле составляют 50 рублей. Реле поступают партиями по 200000 штук. Поскольку качество изделий у поставщика Б хуже, он уступает всю партию на 5000 рублей дешевле. Используя дерево решений, обоснуйте выбор более выгодного поставщика детали ?реле сигнала поворота?. Таблица 3 Оценка качества получаемых изделий Процент брака в партии Вероятности для поставщиков А Б 1% 0,7 0,4 2% 0,1 0,3 3% 0,09 0,15 4% 0,07 0,1 5% 0,04 0,05

Тема 5. Выбор рациональной стратегии в условиях неопределенности и рисков

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Содержание темы: Применение теории игр, матричных игр, игр с природой при решении задач выбора рациональной стратегии в условиях неопределенности. Содержание матрицы эффективности, матрицы затрат, матрицы рисков (упущенной выгоды). Применение критериев: гарантированного результата Вальда, пессимизма, оптимизма, минимаксного риска Сэвиджа, обобщенного максимина Гурвица для выбора рациональной стратегии в условиях неопределенности. Методика выбора рациональной стратегии в условиях риска.

практическое занятие (4 часа(ов)):

ЭЛЕКТРОННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА КФУ

Контрольные вопросы: 1. Раскройте сущность терминов: матричные игры, игры с природой? 2. Какие данные содержат матрица эффективности, матрица затрат, матрица рисков (упущенной выгоды)? 3. Какова сущность критерия гарантированного результата Вальда? Как выбирается рациональная стратегия в соответствие с критерием Вальда? 4. Какова сущность критериев пессимизма и оптимизма? Как выбирается рациональная стратегия в соответствие с этими критериями? 5. Какова сущность критерия минимаксного риска Сэвиджа? Как выбирается рациональная стратегия в соответствие с критерием Сэвиджа? 6. Какова сущность критерия обобщенного максимина Гурвица? Как выбирается рациональная стратегия в соответствие с критерием Гурвица? 7. Как выбирается рациональная стратегия в условиях риска? Практические задания: 1. В таблице 6 дана матрица эффективности. Столбцы матрицы содержат информацию о состоянии внешней среды, а в строках указаны возможные стратегии. На пересечении столбца и строки отражена ожидаемая прибыль в тыс. рублей, которую можно получить при данном состоянии внешней среды и выбранной активной стратегии. Необходимо обосновать и выбрать наиболее эффективную стратегию по критерию Сэвиджа и критерию Гурвица, если лицо, принимающее решение (ЛПР): а) склонно к риску; б) не склонно к риску. Таблица 6 Матрица эффективности Возможные активные стратегии Возможные состояния внешней среды П1 П2 П3 Р1 0,85 0,8 0,90 Р2 0,65 0,45 0,30 Р3 0,35 0,90 0,80 Р4 0,60 0,40 0,90 2. Фирма производит скоропортящуюся продукцию. С учетом существующей статистики по спросу и реализации продукции в течение месяца фирма может реализовать определенное количество упаковок продукции. Известна себестоимость одной упаковки и прибыль от ее продажи. Необходимо учесть тот факт, что производимая продукция имеет малый срок годности ? 1 месяц, а поэтому, если она будет произведена, но не продана, то упаковка продукции должна быть уничтожена. Вероятность спроса на продукцию фирмы в определенных объемах также экспертно определена. Определите, сколько упаковок продукции следует производить фирме, если: а) ее руководство безразлично к риску? а) не склонно к риску? Исходные данные для выполнения задания по вариантам приведены в таблице 7. Таблица 7 Данные для выполнения индивидуальной работы по вариантам Вариант № Количество упаковок производимого товара Вероятности реализации количества упаковок соответственно Себестоимость одной упаковки продукции (тыс. руб.) Прибыль от реализации одной упаковки (тыс. руб.) 1 10; 11; 12 0,3;0,4;0,3 50 20 2 11;12;13 0,2;0,3;0,5 30 30 3 12;13;14 0,5;0,2;0,3 40 10 4 13;14;15 0,2;0,4;0,4 60 40 5 14;15;16 0,1;0,5;0,4 25 20 6 10;11;12 0,3;0,4;0,3 50 30 7 16;17;18 0,2;0,3;0,5 80 40 8 7;8;9 0,5;0,3;0,2 50 40 9 8;9;10 0,4;0,4;0,2 60 50 10 9;10;11 0,4;0,5;0,1 45 60 11 10;11;12 0,3;0,4;0,3 35 50 12 11;12;13 0,2;0,2;0,6 65 50 13 12;13;14 0,5;0,2;0,3 110 200 14 10;11;12 0,2;0,4;0,4 40 20 15 13;14;15 0,1;0,7;0,2 70 50 16 12;13;14 0,3;0,4;0,3 30 10 17 15;16;17 0,6;0,3;0,1 60 35 18 9;10;11 0,5;0,2;0,3 75 40 19 7;8;9 0,2;0,4;0,4 35 25 20 8;9;10 0,3;0,3;0,4 33 15 21 11;12;13 0,3;0,2;0,5 55 10 22 12;13;14 0,4;0,1;0,5 45 20 23 13;14;15 0,6;0,2;0,2 75 30 24 14;15;16 0,3;0,3;0,4 50 20 25 5;6;7 0,2;0,4;0,4 70 40

Тема 6. Измерители и показатели рисков в оценочной деятельности

лекционное занятие (6 часа(ов)):

Содержание темы: Место финансовых рисков в общей иерархии рисков. Сущность и систематизация типичных финансовых рисков организации. Политика управления финансовыми рисками предприятия. Принципы управления финансовыми рисками предприятия. Основные мероприятия по управлению финансовыми рисками. Исследование факторов, влияющих на уровень финансовых рисков предприятия. Методы снижения уровня финансовых рисков.

практическое занятие (6 часа(ов)):

Контрольные вопросы: 1. Укажите место финансовых рисков в общей иерархии рисков. 2. Назовите наиболее важные виды финансовых рисков организации и коротко охарактеризуйте каждый из них. 3. Какие принципы управления финансовыми рисками организации Вам известны? 4. Какие внешние и внутренние факторы типичных финансовых рисков организации Вам известны? 5. Какие методы оценки финансовых рисков Вам известны? 6. Какие методы снижения финансовых рисков используются организациями на практике? 7. Какие финансовые коэффициенты организации используются для анализа уровня финансовых рисков по видам? 8. Какие методы оценки и методы снижения валютных рисков Вам известны? 9. Какие методы оценки и методы снижения процентных рисков Вы знаете?

ЭЛЕКТРОННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА КФУ

Тема 9. Портфельный подход к оценке рисков

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Содержание темы: Риски снижения финансовой устойчивости. Финансовая отчетность организации как источник диагностики уровня рисков снижения финансовой устойчивости. Методика оценки рисков снижения финансовой устойчивости при помощи абсолютных показателей. Методика оценки рисков снижения финансовой устойчивости при помощи относительных показателей. Методика интегральной оценки рисков снижения финансовой устойчивости.

практическое занятие (6 часа(ов)):

Практическое задание 1. На основании анализа финансовой отчетности организации (Форма № 1 и Форма № 2) оценить риски снижения финансовой устойчивости: a) при помощи абсолютных показателей; b) при помощи относительных показателей; c) дать интегральную оценку рисков снижения финансовой устойчивости с использованием зонального метода. Вывести на печать со своим колонтитулом: a) Используемые таблицы исходных абсолютных и относительных показателей с пояснениями формул их расчета. b) Результаты зональной оценки рисков снижения ликвидности по этапам.

Тема 10. Экспертные методы оценки рисков

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Содержание темы: Сущность понятий банкротства и дефолта организации. Факторы угрозы банкротства компании. Методы прогнозирования вероятности банкроьства организации. Методы и модели оценки кредитоспособности и вероятности дефолта компании. Анализ вероятности банкротства с использованием дискриминантных моделей зарубежных и отечественных авторов.

практическое занятие (4 часа(ов)):

Практическое задание : 1. На основании анализа финансовой отчетности организации (Форма № 1 и Форма № 2) оценить вероятность угрозы банкротства организации с использованием дискриминантных моделей (зарубежного и отечественного авторов). Укажите для всех показателей, используемых в моделях вероятности дефолта, в табличной форме способы их расчета с указанием источника информации и номера строки в финансовой отчетности. Вывести на печать со своим колонтитулом: значения используемых показателей с пояснениями формул их расчета и значение риск-функции. Сделать вывод о вероятности дефолта с учетом расчетов по двум моделям.

4.3 Структура и содержание самостоятельной работы дисциплины (модуля)

ЭЛЕКТРОННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА КФУ

N	Раздел дисциплины	Се-местр	Неде-ля семе стра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудо-емкость (в часах)	Формы контроля самосто-ятельной работы
1.	Тема 1. Сущность и содержание риска как экономической категории	6		подготовка к презентации	1	презен-тация
				подготовка к реферату	2	реферат

ЭЛЕКТРОННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА КФУ

N	Раздел дисциплины	Се-местр	Неде-ля семе стра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудо-емкость (в часах)	Формы контроля самосто-ятельной работы
				подготовка к устному опросу	1	устный опрос

N	Раздел дисциплины	Се-местр	Неде-ля семе стра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудо-емкость (в часах)	Формы контроля самосто-ятельной работы
2.	Тема 2. Содержание риск-менеджмента в организации	6		подготовка к презентации	1	Презен-тация
				подготовка к презентации	1	презен-тация
				подготовка к реферату	2	реферат
				подготовка к устному опросу	1	Устный опрос

ЭЛЕКТРОННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА КФУ

N	Раздел дисциплины	Се-местр	Неде-ля семе стра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудо-емкость (в часах)	Формы контроля самосто-ятельной работы
				подготовка к устному опросу	1	устный опрос

N	Раздел дисциплины	Се-местр	Неде-ля семе стра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудо-емкость (в часах)	Формы контроля самосто-ятельной работы
3.	Тема 3. Методы выявления и анализа рисков	6		подготовка к письменной работе	1	Пись-мен-ная работа
				подготовка к письменной работе	2	пись-мен-ная работа
				подготовка к реферату	1	реферат
				подготовка к устному опросу	1	Устный опрос

ЭЛЕКТРОННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА КФУ

N	Раздел дисциплины	Се-местр	Неде-ля семе стра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудо-емкость (в часах)	Формы контроля самосто-ятельной работы
				подготовка к устному опросу	1	устный опрос

N	Раздел дисциплины	Се-местр	Неде-ля семе стра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудо-емкость (в часах)	Формы контроля самосто-ятельной работы
5.	Тема 5. Выбор рациональной стратегии в условиях неопределенности и рисков	6		подготовка к письменной работе	3	Пись-мен-ная работа
				подготовка к письменной работе	2	пись-мен-ная работа
				подготовка к устному опросу	3	Устный опрос

N	Раздел дисциплины	Се-местр	Неде-ля семе стра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудо-емкость (в часах)	Формы контроля самосто-ятельной работы
				подготовка к устному опросу	2	устный опрос

N	Раздел дисциплины	Се-местр	Неде-ля семе стра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудо-емкость (в часах)	Формы контроля самосто-ятельной работы
6.	Тема 6. Измерители и показатели рисков в оценочной деятельности	6		подготовка к презентации	1	Презен-тация
				подготовка к презентации	2	презен-тация
				подготовка к реферату	1	Реферат
				подготовка к реферату	2	реферат
				подготовка к устному опросу	2	Устный опрос

ЭЛЕКТРОННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА КФУ

N	Раздел дисциплины	Се-местр	Неде-ля семе стра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудо-емкость (в часах)	Формы контроля самосто-ятельной работы
				подготовка к устному опросу	2	устный опрос
9.	Тема 9. Портфельный подход к оценке рисков	6		подготовка к творческому заданию	2	Творчес-кое задание
				подготовка к творческому заданию	4	творчес-кое задание
				подготовка к устному опросу	2	Устный опрос
				подготовка к устному опросу	2	устный опрос

ЭЛЕКТРОННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА КФУ

N	Раздел дисциплины	Се-местр	Неде-ля семе стра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудо-емкость (в часах)	Формы контроля самосто-ятельной работы
10.	Тема 10. Экспертные методы оценки рисков	6		подготовка к презентации	2	Презен-тация
				подготовка к презентации	2	презен-тация
				подготовка к реферату	2	Реферат
				подготовка к реферату	2	реферат
	Итого				54	

5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения

Освоение дисциплины 'Финансовые риски организаций' предполагает использование как традиционных лекционных занятий, так и проведение семинарских и практических занятий в компьютерном классе с использованием методических материалов, компьютерных симуляций и инновационных образовательных технологий. Использование инновационных образовательных технологий в учебном процессе предполагает: заслушивание докладов студентов с использованием презентаций, обсуждением сделанных докладов, проведение дискуссии, проведение промежуточного тестирования и обсуждение практических ситуаций.

6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов

Тема 1. Сущность и содержание риска как экономической категории

презентация , примерные вопросы:

Темы презентаций: 1. Трактовка рисков и меры измерения их уровня представителями классической и неоклассической теориий в управлении финансами. 2. Трактовка экономических рисков, их сущность, состав, факторы. 3. Сущность, состав, факторы предпринимательских рисков. 4. Риски в производственном предпринимательстве. 5. Риски в торговле. 6. Риски в сфере туристического бизнеса. 7. Бухгалтерские и налоговые риски. 8. Правовые и операционные риски.

реферат , примерные темы:

Темы докладов: 1. Трактовка рисков и меры измерения их уровня представителями классической и неоклассической теориий в управлении финансами. 2. Трактовка экономических рисков, их сущность, состав, факторы. 3. Сущность, состав, факторы предпринимательских рисков. 4. Риски в производственном предпринимательстве. 5. Риски в торговле. 6. Риски в сфере туристического бизнеса. 7. Бухгалтерские и налоговые риски. 8. Правовые и операционные риски.

устный опрос , примерные вопросы:

Контрольные вопросы: 1. Что такое риск, экономический риск? Назовите основные причины возникновения рисков. 2. Какие точки зрения существуют относительно сущности понятий ?риск? и ?неопределенность?? Чем они отличаются? В чем специфика информационного подхода к разделению этих понятий? 3. В чем состоит объективное и субъективное понимание природы риска? 4. Востребована ли практикой сегодня теоретическая проработка вопросов управления рисками организаций? 5. Чем отличаются классическая и неоклассическая теории финансов в вопросе количественной оценки рисков? 6. Какие факторы влияют на профиль экономических рисков организации? 7. Как следует проводить классификацию рисков в организации? 8. Назовите наиболее важные критерии классификации рисков и различные группы рисков в соответствии с данными критериями.

Тема 2. Содержание риск-менеджмента в организации

Презентация , примерные вопросы:

Темы для подготовки презентаций: 1. Развитие концепции управления рисками в зарубежной и отечественной науке и практике. 2. Сущность, содержание, методы интегрированного риск-менеджмента в организации (ERM-концепция). 3. Содержание и организация риск-менеджмента в компании. Назначение, цель, задачи, ограничения, программа управления рисками в организации. Вопросы финансирования мероприятий по управлению рисками. Анализ подходов к оценке эффективности методов управления рисками. 4. Тактический и стратегический риск-менеджмент. 5. Риск-менеджмент в различных отраслях современного бизнеса. 6. Риск-менеджмент как составная часть финансового менеджмента. 7. Анализ нормативно-правового обеспечения по управлению рисками. 8. Характеристика информации, используемой в управлении рисками.

презентация , примерные вопросы:

Темы для подготовки презентаций: 1. Развитие концепции управления рисками в зарубежной и отечественной науке и практике. 2. Сущность, содержание, методы интегрированного риск-менеджмента в организации (ERM-концепция). 3. Содержание и организация риск-менеджмента в компании. Назначение, цель, задачи, ограничения, программа управления рисками в организации. Вопросы финансирования мероприятий по управлению рисками. Анализ подходов к оценке эффективности методов управления рисками. 4. Тактический и стратегический риск-менеджмент. 5. Риск-менеджмент в различных отраслях современного бизнеса. 6. Риск-менеджмент как составная часть финансового менеджмента. 7. Анализ нормативно-правового обеспечения по управлению рисками. 8. Характеристика информации, используемой в управлении рисками.

реферат , примерные темы:

ЭЛЕКТРОННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА КФУ

Темы рефератов: 1. Развитие концепции управления рисками в зарубежной и отечественной науке и практике. 2. Сущность, содержание, методы интегрированного риск-менеджмента в организации (ERM-концепция). 3. Содержание и организация риск-менеджмента в компании. Назначение, цель, задачи, ограничения, программа управления рисками в организации. Вопросы финансирования мероприятий по управлению рисками. Анализ подходов к оценке эффективности методов управления рисками. 4. Тактический и стратегический риск-менеджмент. 5. Риск-менеджмент в различных отраслях современного бизнеса. 6. Риск-менеджмент как составная часть финансового менеджмента. 7. Анализ нормативно-правового обеспечения по управлению рисками. 8. Характеристика информации, используемой в управлении рисками.

Устный опрос , примерные вопросы:

Контрольные вопросы: 1. Что такое управление рисками? Дайте определение ?риск-менеджменту? в широком и узком понимании. 2. Как развивалась концепция управления рисками в мировой науке? 3. Укажите особенности развития риск-менеджмента в РФ. 4. Укажите цели и задачи риск-менеджмента в организации. 5. Каковы основные принципы управления рисками? 6. Как связаны система управления рисками и стратегия развития организации? 7. В чем состоят особенности и специфика системы управления рисками в различных сферах предпринимательства? 8. Охарактеризуйте процесс управления рисками как динамический процесс. Какие этапы можно выделить в составе процесса управления рисками? В чем состоит суть каждого из этих этапов? 9. Перечислите и охарактеризуйте внутренние и внешние источники информации, используемые для целей управления рисками. 10. Какие методы воздействия на риск Вам известны? В каких случаях их целесообразно использовать? 11. Что такое ?аутсорсинг? в управлении рисками? 12. Какой может быть структура службы риск-менеджмента в нефинансовой компании?

устный опрос , примерные вопросы:

Контрольные вопросы: 1. Что такое управление рисками? Дайте определение ?риск-менеджменту? в широком и узком понимании. 2. Как развивалась концепция управления рисками в мировой науке? 3. Укажите особенности развития риск-менеджмента в РФ. 4. Укажите цели и задачи риск-менеджмента в организации. 5. Каковы основные принципы управления рисками? 6. Как связаны система управления рисками и стратегия развития организации? 7. В чем состоят особенности и специфика системы управления рисками в различных сферах предпринимательства? 8. Охарактеризуйте процесс управления рисками как динамический процесс. Какие этапы можно выделить в составе процесса управления рисками? В чем состоит суть каждого из этих этапов? 9. Перечислите и охарактеризуйте внутренние и внешние источники информации, используемые для целей управления рисками. 10. Какие методы воздействия на риск Вам известны? В каких случаях их целесообразно использовать? 11. Что такое ?аутсорсинг? в управлении рисками? 12. Какой может быть структура службы риск-менеджмента в нефинансовой компании? Контрольные вопросы: 1. Что такое управление рисками? Дайте определение ?риск-менеджменту? в широком и узком понимании. 2. Как развивалась концепция управления рисками в мировой науке? 3. Укажите особенности развития риск-менеджмента в РФ. 4. Укажите цели и задачи риск-менеджмента в организации. 5. Каковы основные принципы управления рисками? 6. Как связаны система управления рисками и стратегия развития организации? 7. В чем состоят особенности и специфика системы управления рисками в различных сферах предпринимательства? 8. Охарактеризуйте процесс управления рисками как динамический процесс. Какие этапы можно выделить в составе процесса управления рисками? В чем состоит суть каждого из этих этапов? 9. Перечислите и охарактеризуйте внутренние и внешние источники информации, используемые для целей управления рисками. 10. Какие методы воздействия на риск Вам известны? В каких случаях их целесообразно использовать? 11. Что такое ?аутсорсинг? в управлении рисками? 12. Какой может быть структура службы риск-менеджмента в нефинансовой компании?

Тема 3. Методы выявления и анализа рисков

Письменная работа , примерные вопросы:

Практические задания для анализа проблемных ситуаций 1. Статистические данные по фактической доходности двух видов ценных бумаг за четыре последних квартала представлены в таблице 1. Таблица 1 Данные о фактических доходностях финансовых активов Номер временного периода Доходность ФА ?А? (в % годовых) Доходность ФА ?Б? (в % годовых) 1 10 14 2 13 11 3 16 12 4 9 8 Оцените количественно ожидаемую доходность и уровень общего риска каждого финансового актива, используя все три количественных показателя уровня риска. Сделайте вывод о том, какой актив предпочтительнее? 2. В таблице 2 представлены данные по возможным значениям ожидаемой доходности каждого из активов и соответствующие им вероятности. Вычислите ожидаемую доходность и оцените риск для акции А и акции Б при помощи показателей дисперсии, стандартного отклонения и коэффициента вариации доходности. Сделайте вывод о том, какой актив предпочтительнее? Таблица 2 Данные о возможных значениях доходностей акций Номер по порядку Возм. значения доходности акции А Вероятность события Возм. значения доходности акции Б Вероятность события 1 17 0,3 18 0,3 2 9 0,3 10 0,3 3 5 0,3 2 0,2 4 -2 0,1 -1 0,2 3. Автомобильный завод получает деталь ?реле сигнала поворота? от двух поставщиков: А и Б. Качество этих изделий характеризуется данными, приведенными в таблице 3. Полные затраты, связанные с ремонтом одного бракованного реле составляют 50 рублей. Реле поступают партиями по 200000 штук. Поскольку качество изделий у поставщика Б хуже, он уступает всю партию на 5000 рублей дешевле. Используя дерево решений, обоснуйте выбор более выгодного поставщика детали ?реле сигнала поворота?. Таблица 3 Оценка качества получаемых изделий Процент брака в партии Вероятности для поставщиков А Б 1% 0,7 0,4 2% 0,1 0,3 3% 0,09 0,15 4% 0,07 0,1 5% 0,04 0,05

письменная работа , примерные вопросы:

Практические задания для анализа проблемных ситуаций 1. Статистические данные по фактической доходности двух видов ценных бумаг за четыре последних квартала представлены в таблице 1. Таблица 1 Данные о фактических доходностях финансовых активов Номер временного периода Доходность ФА ?А? (в % годовых) Доходность ФА ?Б? (в % годовых) 1 10 14 2 13 11 3 16 12 4 9 8 Оцените количественно ожидаемую доходность и уровень общего риска каждого финансового актива, используя все три количественных показателя уровня риска. Сделайте вывод о том, какой актив предпочтительнее? 2. В таблице 2 представлены данные по возможным значениям ожидаемой доходности каждого из активов и соответствующие им вероятности. Вычислите ожидаемую доходность и оцените риск для акции А и акции Б при помощи показателей дисперсии, стандартного отклонения и коэффициента вариации доходности. Сделайте вывод о том, какой актив предпочтительнее? Таблица 2 Данные о возможных значениях доходностей акций Номер по порядку Возм. значения доходности акции А Вероятность события Возм. значения доходности акции Б Вероятность события 1 17 0,3 18 0,3 2 9 0,3 10 0,3 3 5 0,3 2 0,2 4 -2 0,1 -1 0,2 3. Автомобильный завод получает деталь ?реле сигнала поворота? от двух поставщиков: А и Б. Качество этих изделий характеризуется данными, приведенными в таблице 3. Полные затраты, связанные с ремонтом одного бракованного реле составляют 50 рублей. Реле поступают партиями по 200000 штук. Поскольку качество изделий у поставщика Б хуже, он уступает всю партию на 5000 рублей дешевле. Используя дерево решений, обоснуйте выбор более выгодного поставщика детали ?реле сигнала поворота?. Таблица 3 Оценка качества получаемых изделий Процент брака в партии Вероятности для поставщиков А Б 1% 0,7 0,4 2% 0,1 0,3 3% 0,09 0,15 4% 0,07 0,1 5% 0,04 0,05

реферат , примерные темы:

Темы для подготовки рефератов: 1. Метод опросных листов и инспекций в оценке рисков. 2. метод деревьев событий и отказов в оценке рисков. 3. Методики и примеры использования структурных диаграмм и карт технологического потока. 4. Требования профессионального стандарта к специалистам по управлению рисками в компании. 5. Применение метода деревьев решений в риск-менеджменте.

Устный опрос , примерные вопросы:

Темы для подготовки рефератов: 1. Метод опросных листов и инспекций в оценке рисков. 2. метод деревьев событий и отказов в оценке рисков. 3. Методики и примеры использования структурных диаграмм и карт технологического потока. 4. Требования профессионального стандарта к специалистам по управлению рисками в компании. 5. Применение метода деревьев решений в риск-менеджменте.

устный опрос , примерные вопросы:

Контрольные вопросы: 1. Для чего применяются в риск-менеджменте опросные листы и какую информацию они содержат? 2. Укажите назначение карты потоков в риск-менеджменте и информацию, которая в ней отражается? 3. В чем суть запланированных и незапланированных инспекций в управлении рисками? 4. Какая отчетность организации и какая информация из нее используются при оценке экономических рисков организации? 5. Что выполняется на этапе качественной оценки рисков? 6. Какие методы оценки вероятности неблагоприятных событий Вам известны? 7. Какие количественные показатели общего риска актива Вам известны и как они вычисляются? Какой из них наиболее предпочтителен? 8. Как вычисляется ожидаемая доходность финансового актива и фондового портфеля? 9. Как связаны между собой: ожидаемая, номинальная и реальная доходности финансовых активов и фондовых портфелей? 10. Как вычисляются количественные показатели общего риска финансового актива в случае статистического и вероятностного подходов? 11. Какая методика может быть использована при сравнительной оценке и выборе наиболее предпочтительного актива при анализе уровня риска и ожидаемой доходности, в случае, когда у одного актива ? риск выше, но и ожидаемая доходность тоже выше?

Тема 5. Выбор рациональной стратегии в условиях неопределенности и рисков

Письменная работа , примерные вопросы:

Практические задания: 1. В таблице 9 дана матрица эффективности. Столбцы матрицы содержат информацию о состоянии внешней среды, а в строках указаны возможные стратегии. На пересечении столбца и строки отражена ожидаемая прибыль в тыс. рублей, которую можно получить при данном состоянии внешней среды и выбранной активной стратегии. Необходимо обосновать и выбрать наиболее эффективную стратегию по критерию Сэвиджа и критерию Гурвица, если лицо, принимающее решение (ЛПР): а) склонно к риску; б) не склонно к риску. Таблица 9 Матрица эффективности Возможные активные стратегии Возможные состояния внешней среды П1 П2 П3 Р1 0,85 0,8 0,90 Р2 0,65 0,45 0,30 Р3 0,35 0,90 0,80 Р4 0,60 0,40 0,90 Задание 2. Фирма производит косметическую продукцию. В течение года реализуется 15, 16 или 17 упаковок товара. От продажи каждой (одной) упаковки фирма получает 75 тыс. рублей прибыли. Производство одной упаковки товара обходится фирме в 115 тыс. рублей. Производимая косметика имеет малый срок годности ? 1 год, поэтому, если косметика не продана в течение года, то должна быть уничтожена. Вероятность спроса на продукцию фирмы в объеме 15, 16 и 17 упаковок в год составляет: 0,2, 0,45 и 0,35 соответственно. Определите, сколько упаковок косметики следует производить фирме, если ее руководство безразлично к риску?

письменная работа , примерные вопросы:

Практические задания: 1. В таблице 9 дана матрица эффективности. Столбцы матрицы содержат информацию о состоянии внешней среды, а в строках указаны возможные стратегии. На пересечении столбца и строки отражена ожидаемая прибыль в тыс. рублей, которую можно получить при данном состоянии внешней среды и выбранной активной стратегии. Необходимо обосновать и выбрать наиболее эффективную стратегию по критерию Сэвиджа и критерию Гурвица, если лицо, принимающее решение (ЛПР): а) склонно к риску; б) не склонно к риску. Таблица 9 Матрица эффективности Возможные активные стратегии Возможные состояния внешней среды П1 П2 П3 Р1 0,85 0,8 0,90 Р2 0,65 0,45 0,30 Р3 0,35 0,90 0,80 Р4 0,60 0,40 0,90 Задание 2. Фирма производит косметическую продукцию. В течение года реализуется 15, 16 или 17 упаковок товара. От продажи каждой (одной) упаковки фирма получает 75 тыс. рублей прибыли. Производство одной упаковки товара обходится фирме в 115 тыс. рублей. Производимая косметика имеет малый срок годности ? 1 год, поэтому, если косметика не продана в течение года, то должна быть уничтожена. Вероятность спроса на продукцию фирмы в объеме 15, 16 и 17 упаковок в год составляет: 0,2, 0,45 и 0,35 соответственно. Определите, сколько упаковок косметики следует производить фирме, если ее руководство безразлично к риску?

Устный опрос , примерные вопросы:

Контрольные вопросы 1. Раскройте сущность терминов: матричные игры, игры с природой? 2. Какие данные содержат матрица эффективности, матрица затрат, матрица рисков (упущенной выгоды)? 3. Какова сущность критерия гарантированного результата Вальда? Как выбирается рациональная стратегия в соответствие с критерием Вальда? 4. Какова сущность критериев пессимизма и оптимизма? Как выбирается рациональная стратегия в соответствие с этими критериями? 5. Какова сущность критерия минимаксного риска Сэвиджа? Как выбирается рациональная стратегия в соответствие с критерием Сэвиджа? 6. Какова сущность критерия обобщенного максимина Гурвица? Как выбирается рациональная стратегия в соответствие с критерием Гурвица? 7. Как выбирается рациональная стратегия в условиях риска?

устный опрос , примерные вопросы:

Контрольные вопросы 1. Раскройте сущность терминов: матричные игры, игры с природой? 2. Какие данные содержат матрица эффективности, матрица затрат, матрица рисков (упущенной выгоды)? 3. Какова сущность критерия гарантированного результата Вальда? Как выбирается рациональная стратегия в соответствие с критерием Вальда? 4. Какова сущность критериев пессимизма и оптимизма? Как выбирается рациональная стратегия в соответствие с этими критериями? 5. Какова сущность критерия минимаксного риска Сэвиджа? Как выбирается рациональная стратегия в соответствие с критерием Сэвиджа? 6. Какова сущность критерия обобщенного максимина Гурвица? Как выбирается рациональная стратегия в соответствие с критерием Гурвица? 7. Как выбирается рациональная стратегия в условиях риска?

Тема 6. Измерители и показатели рисков в оценочной деятельности

Презентация , примерные вопросы:

Темы презентаций: 1. Охарактеризуйте место, состав и сущность различных видов финансовых рисков, с которыми сталкивается организация. 2. Проанализируйте подходы различных авторов по вопросам классификации финансовых рисков. 3. Сущность, факторы, методы оценок и управления кредитными рисками в компании. 4. Сущность, факторы. методы анализа и снижения валютных и процентных рисков в компаниях. 5. Охарактеризуйте на примере анализа финансовой отчетности механизм влияния финансового рычага на уровень финансовых рисков компании (европейский и американский подходы).

презентация , примерные вопросы:

Темы презентаций: 1. Охарактеризуйте место, состав и сущность различных видов финансовых рисков, с которыми сталкивается организация. 2. Проанализируйте подходы различных авторов по вопросам классификации финансовых рисков. 3. Сущность, факторы, методы оценок и управления кредитными рисками в компании. 4. Сущность, факторы. методы анализа и снижения валютных и процентных рисков в компаниях. 5. Охарактеризуйте на примере анализа финансовой отчетности механизм влияния финансового рычага на уровень финансовых рисков компании (европейский и американский подходы).

Реферат , примерные вопросы:

Темы рефератов: 1. Охарактеризуйте место, состав и сущность различных видов финансовых рисков, с которыми сталкивается организация. 2. Проанализируйте подходы различных авторов по вопросам классификации финансовых рисков. 3. Сущность, факторы, методы оценок и управления кредитными рисками в компании. 4. Сущность, факторы. методы анализа и снижения валютных и центных рисков в компаниях. 5. Охарактеризуйте на примере анализа финансовой отчетности механизм влияния финансового рычага на уровень финансовых рисков компании (европейский и американский подходы).

реферат , примерные темы:

Темы рефератов: 1. Охарактеризуйте место, состав и сущность различных видов финансовых рисков, с которыми сталкивается организация. 2. Проанализируйте подходы различных авторов по вопросам классификации финансовых рисков. 3. Сущность, факторы, методы оценок и управления кредитными рисками в компании. 4. Сущность, факторы. методы анализа и снижения валютных и центных рисков в компаниях. 5. Охарактеризуйте на примере анализа финансовой отчетности механизм влияния финансового рычага на уровень финансовых рисков компании (европейский и американский подходы).

Устный опрос , примерные вопросы:

Контрольные вопросы: 1. Укажите место финансовых рисков в общей иерархии рисков. 2. Назовите наиболее важные виды финансовых рисков организации и коротко охарактеризуйте каждый из них. 3. Какие принципы управления финансовыми рисками организации Вам известны? 4. Какие внешние и внутренние факторы типичных финансовых рисков организации Вам известны? 5. Какие методы оценки финансовых рисков Вам известны? 6. Какие методы снижения финансовых рисков используются организациями на практике? 7. Какие финансовые коэффициенты организации используются для анализа уровня финансовых рисков по видам? 8. Какие методы оценки и методы снижения валютных рисков Вам известны? 9. Какие методы оценки и методы снижения процентных рисков Вы знаете?

устный опрос , примерные вопросы:

Контрольные вопросы: 1. Укажите место финансовых рисков в общей иерархии рисков. 2. Назовите наиболее важные виды финансовых рисков организации и коротко охарактеризуйте каждый из них. 3. Какие принципы управления финансовыми рисками организации Вам известны? 4. Какие внешние и внутренние факторы типичных финансовых рисков организации Вам известны? 5. Какие методы оценки финансовых рисков Вам известны? 6. Какие методы снижения финансовых рисков используются организациями на практике? 7. Какие финансовые коэффициенты организации используются для анализа уровня финансовых рисков по видам? 8. Какие методы оценки и методы снижения валютных рисков Вам известны? 9. Какие методы оценки и методы снижения процентных рисков Вы знаете?

Тема 9. Портфельный подход к оценке рисков

Творческое задание , примерные вопросы:

Творческое задание: 1. Составьте для всех показателей (абсолютных и относительных), используемых для оценки уровня рисков снижения финансовой устойчивости в табличной форме способы их расчета с указанием источника информации и номера строки в финансовой отчетности. 2. На основании анализа финансовой отчетности организации оценить риски снижения финансовой устойчивости: a) при помощи абсолютных показателей; b) при помощи относительных показателей; c) дать интегральную оценку рисков снижения финансовой устойчивости с использованием зонального метода. Вывести на печать со своим колонтитулом: a) Используемые таблицы исходных абсолютных и относительных показателей с пояснениями формул их расчета. b) Результаты зональной оценки рисков снижения ликвидности по этапам.

творческое задание , примерные вопросы:

Творческое задание: 1. Составьте для всех показателей (абсолютных и относительных), используемых для оценки уровня рисков снижения финансовой устойчивости в табличной форме способы их расчета с указанием источника информации и номера строки в финансовой отчетности. 2. На основании анализа финансовой отчетности организации оценить риски снижения финансовой устойчивости: a) при помощи абсолютных показателей; b) при помощи относительных показателей; c) дать интегральную оценку рисков снижения финансовой устойчивости с использованием зонального метода. Вывести на печать со своим колонтитулом: a) Используемые таблицы исходных абсолютных и относительных показателей с пояснениями формул их расчета. b) Результаты зональной оценки рисков снижения ликвидности по этапам.

Устный опрос , примерные вопросы:

Контрольные вопросы: 1. Сущность и факторы рисков снижения финансовой устойчивости организации. 2. Укажите источник диагностики уровня рисков снижения финансовой устойчивости. 3. Охарактеризуйте методику оценки рисков снижения финансовой устойчивости при помощи абсолютных показателей. Перечислите состав используемых показателей и укажите порядок их расчета. 4. Охарактеризуйте методику оценки рисков снижения финансовой устойчивости при помощи относительных показателей. Перечислите состав показателей и укажите порядок их расчета. 5. Охарактеризуйте методику интегральной оценки рисков снижения финансовой устойчивости.

устный опрос , примерные вопросы:

Контрольные вопросы: 1. Сущность и факторы рисков снижения финансовой устойчивости организации. 2. Укажите источник диагностики уровня рисков снижения финансовой устойчивости. 3. Охарактеризуйте методику оценки рисков снижения финансовой устойчивости при помощи абсолютных показателей. Перечислите состав используемых показателей и укажите порядок их расчета. 4. Охарактеризуйте методику оценки рисков снижения финансовой устойчивости при помощи относительных показателей. Перечислите состав показателей и укажите порядок их расчета. 5. Охарактеризуйте методику интегральной оценки рисков снижения финансовой устойчивости.

Тема 10. Экспертные методы оценки рисков

Презентация , примерные вопросы:

Темы для презентаций: 1. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модели Альтмана. Дайте сравнительный анализ моделей Альтмана. 2. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Фулмера. 3. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Чессера. 4. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Спрингейта. 5. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель .С. Сайфуллина и Г.Г. Кадыкова. 6. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель модель ученых Иркутской государственной экономической академии. 7. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Р. Таффлера и Г. Тишоу. 8. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Лисса.

презентация , примерные вопросы:

Темы для презентаций: 1. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модели Альтмана. Дайте сравнительный анализ моделей Альтмана. 2. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Фулмера. 3. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Чессера. 4. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Спрингейта. 5. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель .С. Сайфуллина и Г.Г. Кадыкова. 6. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель модель ученых Иркутской государственной экономической академии. 7. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Р. Таффлера и Г. Тишоу. 8. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Лисса.

Реферат , примерные вопросы:

ЭЛЕКТРОННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА КФУ

Темы для презентаций: 1. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модели Альтмана. Дайте сравнительный анализ моделей Альтмана. 2. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Фулмера. 3. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Чессера. 4. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Спрингейта. 5. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель .С. Сайфуллина и Г.Г. Кадыкова. 6. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель модель ученых Иркутской государственной экономической академии. 7. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Р. Таффлера и Г. Тишоу. 8. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Лисса. Темы для презентаций: 1. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модели Альтмана. Дайте сравнительный анализ моделей Альтмана. 2. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Фулмера. 3. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Чессера. 4. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Спрингейта. 5. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель .С. Сайфуллина и Г.Г. Кадыкова. 6. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель модель ученых Иркутской государственной экономической академии. 7. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Р. Таффлера и Г. Тишоу. 8. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Лисса.

реферат , примерные темы:

ЭЛЕКТРОННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА КФУ

Темы для презентаций: 1. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модели Альтмана. Дайте сравнительный анализ моделей Альтмана. 2. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Фулмера. 3. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Чессера. 4. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Спрингейта. 5. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель .С. Сайфуллина и Г.Г. Кадыкова. 6. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель модель ученых Иркутской государственной экономической академии. 7. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Р. Таффлера и Г. Тишоу. 8. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Лисса. Темы для презентаций: 1. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модели Альтмана. Дайте сравнительный анализ моделей Альтмана. 2. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Фулмера. 3. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Чессера. 4. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Спрингейта. 5. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель .С. Сайфуллина и Г.Г. Кадыкова. 6. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель модель ученых Иркутской государственной экономической академии. 7. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Р. Таффлера и Г. Тишоу. 8. Оцените вероятность банкротства конкретной публичной акционерной компании (ПАО), анализируя ее отчетность и другие необходимы количественные показатели, используя модель Лисса.

Итоговая форма контроля

зачет (в 6 семестре)

Примерные вопросы к зачету:

Перечень вопросов к зачету содержится в Приложении 1

1. Риск, как экономическая категория . Сущность и виды рисков.
2. Критерия принятия решений в условиях частичной неопределенности.
3. Классификация рисков.
4. Критерии рациональности Лапласа.
5. Основные черты риска. Факторы риска. Природа риска.
6. Портфель ценных бумаг. Типы портфелей роста. Типы портфелей дохода.
7. Понятия неопределенности и риска. Основные виды неопределенностей .
8. Основные принципы формирования портфеля ценных бумаг
9. Роль, цели задачи анализа в системе управления риском
10. Модели оценки рисков инвестиционного портфеля.

ЭЛЕКТРОННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА КФУ

11. Роль, цели и задачи оценки рисков в системе управления риском.
12. Портфель Марковица минимального риска.
13. Операционный риск, виды и сущность.
14. Оптимальность по Парето.
15. Методы управления риском. Алгоритм управления риском.
16. Экспертные методы оценки риска. Коллективные методы работы экспертной группы. Индивидуальные мнения экспертов.
17. Матрица последствий и матрица рисков
18. Управления рисками предприятия. (основные принципы, приемы ,этапы)
19. Этапы организации экспертных методов оценки риска.
20. Качественный и количественный методы анализ рисков .
21. Метод анкетирования.
22. Математические методы и модели оценки рисков.
23. Метод "мозгового штурма"
24. Экспертные методы оценки риска.
25. Метод статистической обработки результатов экспертизы
26. Оценка степени согласованности мнений экспертов.
27. Точечная оценка показателей риска. Предельные значения показателей риска.
28. Метод " Дельфи ".Этапы реализации метода "Дельфи "
29. Интервальная оценка риска.
30. Неопределенность и ее виды.
31. Алгоритм экспертного анализа рисков.
32. Алгоритм экспертного анализа риска .
33. Математические методы и модели риска.
34. Этапы организации процесса экспертизы.
35. Критерии принятия решений в условиях полной неопределенности: правило оптимизма и Вальда.
36. Критерии принятия решений в условиях полной неопределенности: правило пессимизма и правило Сэвиджа
37. Метод анализа рисков.
38. Критерии принятия решений в условиях полной неопределенности: правило Гурвица.
39. Статистические показатели риска. Среднее значение . Выборочная средняя
40. Критерии принятия решений в условиях частичной неопределенности: правило Гурвица.
41. Статистические показатели риска.(размах вариации дисперсия, среднее квадратическое отклонение ,доверительный интервал, коэффициент вариации)
42. Система показателей оценки риска.
43. Точечная оценка показателей риска. Предельные значения показателей риска.
44. Метод анкетирования
45. Операционные риски предприятия. Процесс управления операционными рисками предприятия
46. Оценка степени согласованности мнения экспертов (коэффициент вариации, коэффициент ранговой корреляции Спирмена, коэффициента конкордации)
47. Экспертные методы оценки риска. Коллективные методы работы экспертной группы. Индивидуальные мнения экспертов.

7.1. Основная литература:

Инвестиции, Шарп, Уильям Ф.;Александер, Гордон Дж.;Бэйли, Джеффри В., 2010г.

ЭЛЕКТРОННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА КФУ

Теория риска и моделирование рисковых ситуаций, Шапкин, Александр Сергеевич;Шапкин, В.А., 2010г.

1. Инвестиции: учебник / Шарп У.Ф., Александер Г. Д. , Бэйли Д. З. -М.; НИЦ ИНФРА -М, 2016. -1040 с. :70*100 1/16. - (Университетский учебник. Бакалавриат) ISBN 978-5-16-002595-7. Режим доступа: http://znanium.com/bookread2.php?book=551364

2. Теория риска и моделирование рисковых ситуаций: учебник для бакалавров / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. 6 - е изд. - М.: Издательско-торговая корпорация 'Дашков и К'. 2014.880 с. ISBN 978-5-394-02170-1. Режим доступа: http://znanium.com/bookread2.php?book=450763

3. Воробьев С. Н. Упрравление рисками в предпринимательстве [Электронный ресурс] / С. Н. Воробьев, К. В. Балдин. - 4-е изд., испр. М.: Издательско-торговая корпорация 'Дашков и К'. 2013. -482 с. ISBN 978-5-394-01987-6. Режим доступа http://znanium.com/bookread2.php?book=430664.

7.2. Дополнительная литература:

1. Галанов В. А. Производные финансовые инструменты: учебник / В. А. Галагов - 2- изд. перераб. и доп. - М. : НИЦ ИНФРА-М. -М.: 2017. - 208 с. 60*88 1/16. - (Высшее образование) (обложка) ISBN 978-5-16-005723-1. www.dx/doi.org/10.12737/21804/

Режим доступа: http://znanium.com/bookread2.php?book=610326.

2. Грачева М. В. Риск-менеджмент инвестиционного проекта: учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / под редакцией Грачевой М. В. .- М.: ЮНИТИ - ДАНА , 2015. - 544 с. : :0*90 1/16 ISBN 978-5-238-01506-4.

Режим доступа: http://znanium.com/bookread2.php?book=882522

3. Фомичев А. Н. Риск-менеджмент: учебное пособие / Фомичев А. Н. , -4-е изд. -М.: Дашков и К, 2016. - 372 с.ISBN 978-5-394-02767-8.

Режим доступа: http://znanium.com/bookread2.php?book=937403

4. Балдин К. В. Банковский менеджмент : учебник / Ю.Ю. Русанова - М.: Магистр: НИЦ ИНФРА-М, 2015. -480 с. 60*90 1/16. - (Бакалавриат). ISBN 978-5-9776-0355-3 . Режим доступа http://znanium.com/bookread2.php?book=492732

Фомичев А. Н. Риск-менеджмент: учебное пособие / Фомичев А. Н. , -4-е изд. -М.: Дашков и К, 2016. - 372 с.ISBN 978-5-394-02767-8. Режим доступа: http://znanium.com/bookread2.php?book=937403

7.3. Интернет-ресурсы:

Экспертиза рисков - http:// www.riskland.ru

Аналитическая информация о финансовых рынках - http:// www.k2kapital.com

Бизнес-ресурсы - http:// www.dir.Yahoo.com/Business_and_Economy

Московская межбанковская валютная биржа - http:// www.micex.ru

Официальный сайт Министерства финансов РФ - http://www.minfin.ru

Сайт Центрального банка России - http:// www.cbr.ru

Финансовая информация - http:// www.mdf.ru

Финансовые риски - http:// www. finrisk.ru

Энциклопедия банковского дела и финансов - http://www.cofe.ru/Finance

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины(модуля)

Освоение дисциплины "Риски в оценочной деятельности" предполагает использование следующего материально-технического обеспечения:

ЭЛЕКТРОННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА КФУ

Мультимедийная аудитория, вместимостью более 60 человек. Мультимедийная аудитория состоит из интегрированных инженерных систем с единой системой управления, оснащенная современными средствами воспроизведения и визуализации любой видео и аудио информации, получения и передачи электронных документов. Типовая комплектация мультимедийной аудитории состоит из: мультимедийного проектора, автоматизированного проекционного экрана, акустической системы, а также интерактивной трибуны преподавателя, включающей тач-скрин монитор с диагональю не менее 22 дюймов, персональный компьютер (с техническими характеристиками не ниже Intel Core i3-2100, DDR3 4096Mb, 500Gb), конференц-микрофон, беспроводной микрофон, блок управления оборудованием, интерфейсы подключения: USB,audio, HDMI. Интерактивная трибуна преподавателя является ключевым элементом управления, объединяющим все устройства в единую систему, и служит полноценным рабочим местом преподавателя. Преподаватель имеет возможность легко управлять всей системой, не отходя от трибуны, что позволяет проводить лекции, практические занятия, презентации, вебинары, конференции и другие виды аудиторной нагрузки обучающихся в удобной и доступной для них форме с применением современных интерактивных средств обучения, в том числе с использованием в процессе обучения всех корпоративных ресурсов. Мультимедийная аудитория также оснащена широкополосным доступом в сеть интернет. Компьютерное оборудованием имеет соответствующее лицензионное программное обеспечение.

Компьютерный класс, представляющий собой рабочее место преподавателя и не менее 15 рабочих мест студентов, включающих компьютерный стол, стул, персональный компьютер, лицензионное программное обеспечение. Каждый компьютер имеет широкополосный доступ в сеть Интернет. Все компьютеры подключены к корпоративной компьютерной сети КФУ и находятся в едином домене.

Учебно-методическая литература для данной дисциплины имеется в наличии в электронно-библиотечной системе " БиблиоРоссика", доступ к которой предоставлен студентам. В ЭБС " БиблиоРоссика " представлены коллекции актуальной научной и учебной литературы по гуманитарным наукам, включающие в себя публикации ведущих российских издательств гуманитарной литературы, издания на английском языке ведущих американских и европейских издательств, а также редкие и малотиражные издания российских региональных вузов. ЭБС "БиблиоРоссика" обеспечивает широкий законный доступ к необходимым для образовательного процесса изданиям с использованием инновационных технологий и соответствует всем требованиям федеральных государственных образовательных стандартов высшего профессионального образования (ФГОС ВПО) нового поколения.

Учебно-методическая литература для данной дисциплины имеется в наличии в электронно-библиотечной системе "ZNANIUM.COM", доступ к которой предоставлен студентам. ЭБС "ZNANIUM.COM" содержит произведения крупнейших российских учёных, руководителей государственных органов, преподавателей ведущих вузов страны, высококвалифицированных специалистов в различных сферах бизнеса. Фонд библиотеки сформирован с учетом всех изменений образовательных стандартов и включает учебники, учебные пособия, УМК, монографии, авторефераты, диссертации, энциклопедии, словари и справочники, законодательно-нормативные документы, специальные периодические издания и издания, выпускаемые издательствами вузов. В настоящее время ЭБС ZNANIUM.COM соответствует всем требованиям федеральных государственных образовательных стандартов высшего профессионального образования (ФГОС ВПО) нового поколения.

Учебно-методическая литература для данной дисциплины имеется в наличии в электронно-библиотечной системе Издательства "Лань" , доступ к которой предоставлен студентам. ЭБС Издательства "Лань" включает в себя электронные версии книг издательства "Лань" и других ведущих издательств учебной литературы, а также электронные версии периодических изданий по естественным, техническим и гуманитарным наукам. ЭБС Издательства "Лань" обеспечивает доступ к научной, учебной литературе и научным периодическим изданиям по максимальному количеству профильных направлений с соблюдением всех авторских и смежных прав.

Материально-техническое обеспечение дисциплины

- компьютерные классы с выходом в интернет;

ЭЛЕКТРОННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА КФУ

- аудитории, оборудованные мультимедийными средствами обучения.

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВПО и учебным планом по направлению 38.03.01 "Экономика" и профилю подготовки не предусмотрено .

Автор(ы):
Сафиуллин А.Р. _____
Хайруллина А.Д. _____
Девятков Тимур Владимирович _____
"__" _____ 201 __ г.

Рецензент(ы):
Якупова Н.М. _____
"__" _____ 201 __ г.