

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Баламирзоев Назим Лидиевич
Должность: Ректор
Дата подписания: 21.02.2025 12:55:00
Уникальный идентификатор:
5cf0d6f89e80f49a334f6a4ba58e91f3326b9926

Министерство науки и высшего образования РФ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«Дагестанский государственный технический университет»

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Дисциплина Оценка рисков
наименование дисциплины по ОПОП

для специальности 38.05.01 Экономическая безопасность
код и полное наименование направления (специальности)

специализация Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности


факультет Информационных систем в экономике и управлении
наименование факультета, где ведется дисциплина

кафедра Экономическая безопасность и таможенное дело
наименование кафедры, за которой закреплена дисциплина

Форма обучения очная, заочная курс 4 семестр 7
очная, заочная


г. Махачкала 2022 г.

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность с учетом рекомендаций ОПОП ВО по специальности и специализации подготовки «Экономическая безопасность».

Разработчик  Шахбанова И.К., к.э.н., доцент
подпись (ФИО уч. степень, уч. звание)

« 09 » 09 2022 г.

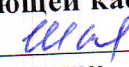
Зав. кафедрой, за которой закреплена дисциплина (модуль) _____

 Шахбанова И.К., к.э.н., доцент
подпись (ФИО уч. степень, уч. звание)

« 17 » 09 2022 г.

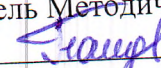
Программа одобрена на заседании выпускающей кафедры ЭБиТД от 17.09.22 г., протокол № 1.

Зав. выпускающей кафедрой по данному направлению (специальности, профилю)

 Шахбанова И.К., к.э.н., доцент
подпись (ФИО уч. степень, уч. звание)

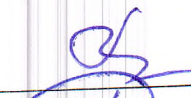
« 17 » 09 2022 г.

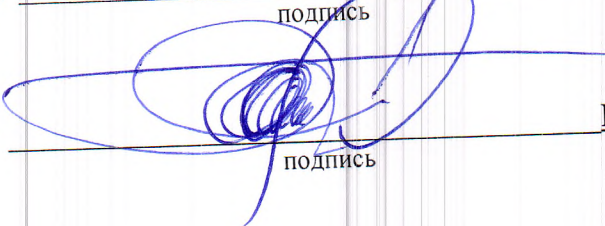
Программа одобрена на заседании Методического совета факультета ИСвЭиУ от 21.09.22 года, протокол № 1

Председатель Методического совета факультета ИСвЭиУ
 к.э.н., Гаджиева Н.М.
подпись (ФИО уч. степень, уч. звание)

« 21 » 09.2022 г.

Декан факультета  З.Р.Раджабова
подпись ФИО

Начальник УО  Э.В. Магомаева
подпись ФИО

Врио ректора  Н.Л. Баламирзоев
подпись ФИО

1. Цели и задачи освоения дисциплины

Целями освоения дисциплины «Оценка рисков» является обеспечение студентов теоретическими и практическими знаниями в области разработки и принятия управленческих решений в условиях неопределенности и риска; получение знаний о качественных и количественных свойствах разработки и принятия управленческих решений с учетом риска; знакомство с концепцией «приемлемого» уровня риска; овладение навыками эмпирического исследования риска, определения его показателей; рассмотрение системы управления рисками организации в целостности и единстве ее компонентов, овладение навыками использования методов управления рисками; овладение методологией и методикой построения, анализа и использования экономико - математических моделей измерения степени риска.

Задачи освоения дисциплины:

- формирование системных представлений о сущности риска и его видах.
- освоение методических подходов к оценке рисков.
- изучение возможностей имитационного моделирования для оценки риска.

2. Место дисциплины в структуре ОПОП

Дисциплина относится к обязательной части плана, формируемой участниками образовательных отношений, осваивается на четвертом курсе в седьмом семестре.

Дисциплина находится в логической и содержательно-методической взаимосвязи с другими частями ОПОП и базируется на взаимодействии со следующими дисциплинами ОПОП, участвующими в формировании соответствующих компетенций: Финансы, Экономическая безопасность регионов, Деньги, кредит, банки, Эконометрика.

3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины «Оценка рисков»

В результате освоения дисциплины «Оценка рисков» обучающийся по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность, в соответствии с ФГОС ВО и ОПОП ВО должен обладать следующими компетенциями:

Код компетенции	Наименование компетенции	Наименование показателя оценивания (показатели достижения заданного уровня освоения компетенций)
ПК-5	Способен проводить экономические расчеты, направленные на идентификацию, анализ и оценку рисков	ПК-5.1. Знает характеристики ситуации неопределенности, основные принципы оценки риска; современные информационные системы и технологии управления рисками и возможности их применения; стратегии, методы управления рисками и варианты их применения
		ПК-5.2. Умеет осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики
		ПК-5.3. Владеет навыками оценки эффективности воздействия на риск: выбор варианта или метода воздействия на риск, подготовка и внедрение планов воздействия на риск

		ПК-5.4. Владеет навыками построения карты риска и методами подготовки и внедрения планов воздействия на риск в целях обеспечения экономической безопасности
--	--	---

4. Объем и содержание дисциплины (модуля)

Форма обучения	очная	заочная
Общая трудоемкость по дисциплине (ЗЕТ/ в часах)	4/144	4/144
Лекции, час	34	9
Практические занятия, час	34	9
Лабораторные занятия, час	-	-
Самостоятельная работа, час	40	117
Курсовой проект (работа), РГР, семестр	-	-
Зачет (при заочной форме 4 часа отводится на контроль)	-	-
Часы на экзамен (при очной, очно-заочной формах 1 ЗЕТ – 36 часов , при заочной форме – 9 часов)	Экзамен	Экзамен

4.1. Содержание дисциплины (модуля)

№ п/п	Раздел дисциплины, тема лекции и вопросы	Очная форма						Заочно		
		ЛК	ПЗ	ЛБ	СР	ЛК	ПЗ	ЛБ	СР	
1.	Глава 1. Сущность, виды и критерии риска 1.1. Понятие риска 1.2. Функции управления риском 1.3. Классификация рисков 1.4. Потери от риска	5	5		6	2	2		17	
2.	Глава 2. Общее описание методов управления рисками 2.1. Процедуры управления риском 2.2. Основные способы и инструменты управления рисками	5	5		6			17		
3.	2.3. Методы анализа рисков: вариация, дисперсия, стандартное отклонение, дерево решений 2.4. Концепция рисковой стоимости	5	5		6	2	2	17		
4.	Глава 3. Финансовые риски 3.1. Классификация финансовых рисков 3.2. Методы управления финансовыми рисками 3.3. Бюджетирование как метод управления финансовыми рисками	5	5		6	2		17		
5.	3.4. Способы фиксации денежных потоков в процессе диссипации и компенсации финансового риска 3.5. Анализ валютного риска, риска объема производства и сбыта продукции 3.6. Учет риска в доходном подходе к оценке бизнеса	5	5		6	2		17		
6.	Глава 4. Инвестиционные риски 4.1 Анализ риска в инвестиционных расчетах 4.2. Анализ риска инвестиционного портфеля 4.3. Метод Монте-Карло	5	5		5	2	2	17		
7.	Глава 5. Анализ странового риска	4	4		5	1	1	15		
		Входная конт. работа		Входная конт. работа		Входная конт. работа				
		1 аттестация 1-3 темы		1 аттестация 1-3 темы		Контрольная работа №1				
		2 аттестация 3-5 темы		2 аттестация 3-5 темы						
		3 аттестация 5-8 темы		3 аттестация 5-8 темы						
	Форма текущего контроля успеваемости (по срокам текущих аттестаций в семестре)	Экзамен в 7 семестре		Экзамен в 7 семестре		Экзамен в 7 семестре				
	Форма промежуточной аттестации (по семестрам)	34	34		40	9	9	117		
	Итого									

4.2. Содержание практических занятий

№ п/п	№ лекции из рабочей программы	Наименование практического (семинарского) занятия	Количество часов		Рекомендуемая литература и методические разработки (№ источника из списка литературы)
			очно	заочно	
1	1	Теоретические основы управления рисками	6	2	1,2
2	2	Методологическая база оценки и анализа рисков	6		2
3	3	Основы систем управления рисками	6	2	3,4
4	4	Особенности анализа и оценки рисков хозяйственной деятельности предприятий (организаций)	6	2	5,6
5	5	Особенности анализа и оценки рисков в финансово-кредитной сфере	6	2	1,2,3,4
6	6	Особенности анализа и оценки рисков в области государственных финансов	4	1	8,7
Итого			34	9	

4.3. Тематика для самостоятельной работы студента

№ п/п	Тематика по содержанию дисциплины, выделенная для самостоятельного изучения	Количество часов из содержания дисциплины		Рекомендуемая литература и источники информации	Формы контроля СРС
		очно	заочно		
1	2	3		5	6
		4	13	1,3	Реферат, статья
1.	1. Сущность риска как объекта управления	4	13	1,2	Реферат, статья
2.	2. Концепция приемлемого риска	4	13	2	Реферат, статья
3.	3. Цель и задачи риск-менеджмента	4	13	3,4	Реферат, статья
4.	4. Риск-менеджмент как система управления	4	13	2,4	Реферат, статья
5.	5. Технология риск-менеджмента	5	13	1,2,3	Реферат, статья
6.	6. Выявление факторов риска: внешние факторы риска	5	13	4	Реферат, статья
7.	7. Выявление факторов риска: внутренние факторы риска	5	13	5	Реферат, статья
8.	8. Идентификация факторов риска	5	13	3,4	Реферат, статья
9.	9. Основы построения системы факторов риска	40	117		
	Итого:				

5. Образовательные технологии

Требуемые результаты освоения дисциплины «Оценка рисков» достигаются за счет использования в процессе обучения (при проведении аудиторных занятий и организации самостоятельной работы, в том числе и в дистанционном формате) интерактивных методов и технологий формирования компетенций у студентов, в частности - развивающие проблемно-ориентированные технологии, направленные на формирование и развитие проблемного мышления, способности видеть и формулировать проблемы, выбирать способы и средства для их решения.

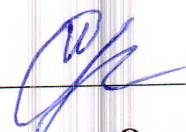
В процессе изучения дисциплины используются традиционные и инновационные технологии, активные и интерактивные методы и формы обучения.

- на лекционных занятиях: лекция-беседа или диалог с аудиторией; лекция – дискуссия; лекция с применением техники обратной связи; лекция с применением элементов «мозговой атаки»; лекция с разбором микроситуаций; лекция- консультация; групповая консультация («пресс-конференция»);
- на практических занятиях: решение ситуационных задач, тестирование, деловые игры, учебная дискуссия, круглый стол, семинары, работа в группах, коллоквиумы;
- для самостоятельной работы студентов: подготовка рефератов и докладов по отдельным темам, подготовка к тестированию, самостоятельное изучение тем, работа с дополнительной литературой, подготовка к семинару – презентации.

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

Оценочные средства для контроля входных знаний, текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины «Оценка рисков» приведены в приложении А (Фонд оценочных средств) к данной рабочей программе.

Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов приведено ниже в пункте 7 настоящей рабочей программы.



7. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины «Оценка рисков»

№ № п/п	Виды занятия	Необходимая учебная, учебно-методическая (основная и дополнительная) литература, программное обеспечение и Интернет ресурсы Автор(ы). Издательство, год издания	Количество изданий	
			в били отеке	на кафед ре
1	2	3	4	5
Основная				
1	Лк, пз, срс	Анализ и оценка рисков: методические указания к практическому занятию по дисциплине «Управление рисками в образовании» / составители Е. В. Савенкова. — Москва: Московский педагогический государственный университет, 2018. — 24 с. — ISBN 978-5-4263-0652-3. — Текст: электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART: [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/97807.html	+	+
2	Лк, пз, срс	Соловьева, Н. В. Оценка и управление рисками предприятий химической промышленности : монография / Н. В. Соловьева. — 2-е изд. — Москва : Дашков и К, 2022. — 188 с. — ISBN 978-5-394-04768-8. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/120746.html	+	+
3	Лк, пз, срс	Колбин, В. В. Оценка и управление риском / В. В. Колбин, В. А. Ледовская. — 2-е изд., стер. — Санкт-Петербург : Лань, 2023. — 248 с. — ISBN 978-5-507-46864-5. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: https://e.lanbook.com/book/322655	+	+
4	Лк, пз, срс	Охотников, И. В. Оценка рисков : учебно-методическое пособие / И. В. Охотников, И. В. Сибирко. — Москва : РУТ (МИИТ), 2018. — 76 с. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: https://e.lanbook.com/book/173758	+	+
5	Лк, пз, срс	Тушавин, В. А. Методы и средства оценки рисков : учебное пособие / В. А. Тушавин. — Санкт-Петербург : ГУАП, 2022. — 123 с. — ISBN 978-5-8088-1752-4. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: https://e.lanbook.com/book/340994	+	+
6	Лк, пз, срс	Будович, Л. С. Бизнес-планирование в предпринимательской деятельности : учебно-методическое пособие / Л. С. Будович, Ю. В. Старцева. — Москва : РТУ МИРЭА, 2021. — 177 с. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: https://e.lanbook.com/book/182556	+	+
7	Лк, пз, срс	Бекаева, А. В. Финансовый анализ : учебное пособие / А. В. Бекаева. — Москва : РТУ МИРЭА, 2021. — 103 с. — ISBN 978-5-7339-1396-4. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: https://e.lanbook.com/book/182409	+	+

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины «Оценка рисков»

Материально-техническое обеспечение дисциплины «Оценка рисков» включает:

- библиотечный фонд (учебная, учебно-методическая, справочная юридическая литература, юридическая научная и деловая периодика);
- компьютеризированные рабочие места для обучающихся с доступом в сеть Интернет;
- аудитории, оборудованные проекционной техникой.

Для проведения лекционных занятий используется лекционный зал факультета информационных систем в экономике и управлении, оборудованный проектором и интерактивной доской.

Для проведения практических занятий используются компьютерные классы факультета информационных систем в экономике и управлении, оборудованные современными персональными компьютерами с соответствующим программным обеспечением.

Специальные условия инвалидам и лицам с ограниченными возможностями здоровья (ОВЗ)

Специальные условия обучения и направления работы с инвалидами и лицами с ОВЗ определены на основании:

- Федерального закона от 29.12.2012 №273-ФЗ «Об образовании в Российской Федерации»;
- Федерального закона от 24.11.1995 № 181-ФЗ «О социальной защите инвалидов в Российской Федерации»;
- приказа Минобрнауки России от 05.04.2017 № 301 «Об утверждении Порядка организации и осуществления образовательной деятельности по образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры»;
- методических рекомендаций по организации образовательного процесса для обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья в образовательных организациях высшего образования, в том числе оснащенности образовательного процесса, утвержденных Минобрнауки России 08.04.2014 № АК-44/05вн).

Под специальными условиями для получения образования обучающихся с ОВЗ понимаются условия обучения, воспитания и развития, включающие в себя использование при необходимости адаптированных образовательных программ и методов обучения и воспитания, специальных учебников, учебных пособий и дидактических материалов, специальных технических средств обучения коллективного и индивидуального пользования, предоставление услуг ассистента (помощника), оказывающего необходимую помощь, проведение групповых и индивидуальных коррекционных занятий, обеспечение доступа в здания ДГТУ и другие условия, без которых невозможно или затруднено освоение ОПОП обучающихся с ОВЗ.

Обучение в рамках учебной дисциплины обучающихся с ОВЗ осуществляется ДГТУ с учетом особенностей психофизического развития, индивидуальных возможностей и состояния здоровья таких обучающихся.

Обучение по учебной дисциплине обучающихся с ОВЗ может быть организовано как совместно с другими обучающимися, так и в отдельных группах.

В целях доступности обучения по дисциплине обеспечивается:

- 1) для лиц с ограниченными возможностями здоровья по зрению:
 - наличие альтернативной версии официального сайта ДГТУ в сети «Интернет» для слабовидящих;
 - весь необходимый для изучения материал, согласно учебному плану (в том числе, для обучающихся по индивидуальным учебным планам) предоставляется в электронном виде на диске;
 - индивидуальное равномерное освещение не менее 300 люкс;
 - присутствие ассистента, оказывающего обучающемуся необходимую помощь;
 - обеспечение возможности выпуска альтернативных форматов печатных материалов (крупный шрифт или аудиофайлы);
 - обеспечение доступа обучающегося, являющегося слепым и использующего собаку-проводника, к зданию ДГТУ.
- 2) для лиц с ОВЗ по слуху:
 - наличие микрофонов и звукоусиливающей аппаратуры коллективного пользования (аудиоколонки);
- 3) для лиц с ОВЗ, имеющих нарушения опорно-двигательного аппарата, материально-технические условия должны обеспечивать возможность беспрепятственного доступа обучающихся в учебные помещения, столовые, туалетные и другие помещения организации, а также пребывания в указанных помещениях (наличие пандусов, поручней, расширенных дверных проемов и других приспособлений).

Перед началом обучения могут проводиться консультативные занятия, позволяющие студентам с ОВЗ адаптироваться к учебному процессу.

В процессе ведения учебной дисциплины научно-педагогическим работникам рекомендуется использование социально-активных и рефлексивных методов обучения, технологий социокультурной реабилитации с целью оказания помощи обучающимся с ОВЗ в установлении полноценных межличностных отношений с другими обучающимися, создании комфортного психологического климата в учебной группе.

Особенности проведения текущей и промежуточной аттестации по дисциплине для обучающихся с ОВЗ устанавливаются с учетом индивидуальных психофизических особенностей (устно, письменно на бумаге, письменно на компьютере, в форме тестирования и др.). При необходимости предоставляется дополнительное время для подготовки ответа на зачете или экзамене.