

**Федеральное государственное бюджетное образовательное  
учреждение высшего образования  
«Санкт-Петербургский университет  
Государственной противопожарной службы МЧС России»**

**УТВЕРЖДАЮ**

**Заместитель начальника  
университета по учебной работе  
полковник внутренней службы**

**А.А. Горбунов**

«27» мая 2020г.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ  
ОЦЕНКА И АНАЛИЗ РИСКОВ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОГО  
ОБЕСПЕЧЕНИЯ**

**Направление подготовки  
38.03.04 Государственное и муниципальное управление  
Профиль - Материально-техническое обеспечение**

**Уровень бакалавриата**

## 1. Цели и задачи дисциплины

### Цели освоения дисциплины:

- формирование знаний о современных методах управления проектом, направленных на своевременное получение качественных результатов, определение рисков, эффективное управление ресурсами, готовностью к его реализации с использованием современных инновационных технологий;
- формирование комплексов знаний, умений и практических навыков, необходимых для оценки соотношения планируемого результата и затрачиваемых ресурсов.

### Перечень компетенций, формируемых в процессе изучения дисциплины

Компетенции	Содержание
<b>ПК-1</b>	умение определять приоритеты профессиональной деятельности, разрабатывать и эффективно исполнять управленческие решения, в том числе в условиях неопределенности и рисков, применять адекватные инструменты и технологии регулирующего воздействия при реализации управленческого решения
<b>ПК-13</b>	способность использовать современные методы управления проектом, направленные на своевременное получение качественных результатов, определение рисков, эффективное управление ресурсами, готовностью к его реализации с использованием современных инновационных технологий
<b>ПК-18</b>	способность принимать участие в проектировании организационных действий, умением эффективно исполнять служебные (трудовые) обязанности
<b>ПК-22</b>	умение оценивать соотношение планируемого результата и затрачиваемых ресурсов
<b>ПСК-4</b>	осуществление контроля и оценки состояния обеспечения горючим и смазочными материалами, продовольственного и вещевого обеспечения служебной деятельности Министерства Российской Федерации по делам гражданской обороны, чрезвычайным ситуациям и ликвидации последствий стихийных бедствий

### Задачи дисциплины:

- изучение теоретических основ управления рисками.
- формирование знаний, необходимых для осмысления процессов, происходящих в материально техническом обеспечении и рисков, с ними связанных;
- формирование знаний, связанных с умением выявлять проблемы, определять цели, оценивать риски и альтернативы, выбирать оптимальный

вариант решения, оценивать его результаты и последствия;

- изучение методологических основ принятия риск-решений;
- изучение методологии адаптивного динамического управления рисками.

## 2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Планируемые результаты обучения по дисциплине	Планируемые результаты освоения образовательной программы
В результате освоения дисциплины обучающийся должен <b>демонстрировать способность и готовность</b>	В результате освоения образовательной программы обучающийся должен владеть компетенциями
осуществлять контроля и оценки состояния обеспечения горючим и смазочными материалами, продовольственного и вещевого обеспечения служебной деятельности Министерства Российской Федерации по делам гражданской обороны, чрезвычайным ситуациям и ликвидации последствий стихийных бедствий	<b>ПСК-4</b>
<b>в организационно-управленческой деятельности:</b>	
определять приоритеты профессиональной деятельности, разрабатывать и эффективно исполнять управленческие решения, в том числе в условиях неопределенности и рисков, применять адекватные инструменты и технологии регулирующего воздействия при реализации управленческого решения	<b>ПК-1</b>
<b>в проектной деятельности:</b>	
использовать современные методы управления проектом, направленные на своевременное получение качественных результатов, определение рисков, эффективное управление ресурсами, готовностью к его реализации с использованием современных инновационных технологий	<b>ПК-13</b>
<b>в организационно-регулирующей деятельности:</b>	
принимать участие в проектировании организационных действий, умением эффективно исполнять служебные (трудовые) обязанности	<b>ПК-18</b>
оценивать соотношение планируемого результата и затрачиваемых ресурсов	<b>ПК-22</b>

## 3. Место дисциплины в структуре основной профессиональной образовательной программы

Дисциплина относится к вариативной части основной профессиональной образовательной программы по направлению подготовки 38.03.04

Государственное и муниципальное управление, профиль – материально-техническое обеспечение (уровень бакалавриата)

#### 4. Структура и содержание дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины составляет 4 зачетных единицы - 144 часа.

##### 4.1 Объем дисциплины и виды работы

##### 4.1.1. для очной формы обучения

Вид работы	Всего часов	Семестр
		6
Общая трудоемкость дисциплины в часах	144	144
Общая трудоемкость дисциплины в зачетных единицах	4	4
<b>Контактная работа (всего)</b>	<b>72</b>	<b>72</b>
В том числе:		
Лекции	36	36
Практические занятия	36	36
<b>Контроль</b>		
Форма контроля – зачет с оценкой	+	+
<b>Самостоятельная работа</b>	<b>72</b>	<b>72</b>

#### 4.2 Темы дисциплины и виды занятий для очной формы обучения

№ п.п.	Наименование тем	Всего часов	Количество часов по видам занятий		Контроль	Самостоятельная Работа
			Лекции	Практические занятия		
1	2	3	4	5	6	7
1	Риск: понятие и сущность	16	4	4		8
2	Исторический аспект управления рисками	8	2	2		4
3	Рискообразующие факторы в материально-техническом обеспечении	8	2	2		4
4	Управление риском	8	2	2		4
5	Анализ и оценка риска	8	2	2		4
6	Оценка риска в условиях определенности	8	2	2		4
7	Оценка риска в условиях частичной неопределенности	8	2	2		4
8	Оценка риска в условиях неопределенности	8	2	2		4
9	Экспертные методы и процедуры оценки риска	8	2	2		4
10	Оценка финансовых рисков	8	2	2		4
11	Комплексная оценка риска финансовой несостоятельности	8	2	2		4
12	Оценка рисков инвестиционных проектов	16	4	4		8
13	Оценка специфических рисков	16	4	4		8
14	Механизмы нейтрализации риска в материально-техническом обеспечении	16	4	4		8
	<b>Зачет с оценкой</b>				+	
	<b>Итого по дисциплине</b>	<b>144</b>	<b>36</b>	<b>36</b>		<b>72</b>

#### 4.3 Содержание дисциплины

**Тема 1. Риск: понятие и сущность.**

**Лекция.** Риск: понятие и сущность.

Государственный стандарт РФ ГОСТ Р 51897—2002 «Менеджмент риска. Термины и определения»: характеристика основных понятий - «риск»,

«вероятность», «неопределенность», «менеджмент риска».

Понятия «неопределенность» и «риск», их соотнесение между собой. Понятия «опасность», «угроза», «уязвимость», «ущерб» и «риск», их соотнесение между собой.

Функции, источники и факторы возникновения риска. Выявление, оценка, управление и контроль риска. Основные черты риска. Основные причины неопределенности и источников риска. Основные точки зрения на природу риска. Классификация рискообразующих факторов экономического риска. Общие принципы классификации рисков. Внешние риски: политический, региональный, рыночный и т.д. Внутренние риски: операционный, финансовый, управленческий, инвестиционный, производственный. Способы выявления и идентификации рисков.

**Практическое занятие.** Выявление, оценка, управление и контроль риска в конкретных ситуациях.

**Самостоятельная работа.** Основные понятия риска, его основные элементы и черты.

**Рекомендуемая литература:**

основная [1,2];

дополнительная [1, 2].

## **Тема 2. Исторический аспект управления рисками**

**Лекция.** Исторический аспект управления рисками.

Основные идеи классической теории рисков. Сущность экономической парадигмы маржиналистов. Риски и инновационные инвестиции, их соотнесение между собой согласно марксистского учения о рисках. Вклад Дж. Кейнса в неоклассическую теорию риска. Подходы к оценке роли предпринимателей в теории институциональной теории рисков.

Концепции риска. Основное направление управления риском. Аксиомы, законы и принципы управления рисками.

Закон единства систем управления для риск-менеджмента.

Закон зависимости доходов и риска.

Системный подход в управлении рисками.

**Практическое занятие.** Сопоставление величины риска и дохода.

**Самостоятельная работа.** Аксиомы, законы и принципы управления рисками.

**Рекомендуемая литература:**

основная [1,2];

дополнительная [1, 2].

## **Тема 3. Рискообразующие факторы в материально-техническом обеспечении**

Анализ опасностей. Виды потенциального ущерба в материально-техническом обеспечении. Виды опасности по источнику возникновения. Виды опасностей по масштабу. Формы проявления опасности для функционирования

организации.

Соотношения последствий и ущерба. Особенности прямого, косвенного, полного и общего ущерба в материально-техническом обеспечении.

Человеческий фактор и риск. Классификация причин опасных действий персонала. Основные проявления человеческого фактора при оценке риска. Влияние социотехногенных факторов на риск. Факторы, оказывающие воздействие на вероятность ошибок в работе персонала.

Информационная безопасность в организациях. Направления работы по обеспечению безопасности работы компании.

**Практическое занятие.** Анализ потенциальных опасностей внешней и внутренней среды.

**Самостоятельная работа.** Виды потенциального ущерба в материально-техническом обеспечении.

**Рекомендуемая литература:**

основная [1,2];

дополнительная [1, 2].

#### **Тема 4. Управление риском**

Управление риском (риск-менеджмент): понятие, цель, задачи и функции. Система управления риском. Модель риск-менеджмента. Основные принципы управления риском. Характеристика видов возможных потерь.

Ведущие международные и отечественные рейтинговые агентства: их роль в оценке риска.

Технология управления риском как трехэтапный процесс мероприятий.

Стратегия риск-менеджмента. Сущность тактики риск-менеджмента. Алгоритм управления риском в системе управления предприятием. Организационная структура, реализующая функции риск-менеджмента. Цели, задачи и функции риск-менеджмента. Алгоритм управления риском в системе управления предприятием по этапам.

**Самостоятельная работа.** Организация системы риск-менеджмента.

**Рекомендуемая литература:**

основная [1,2];

дополнительная [1, 2].

#### **Тема 5. Анализ и оценка риска**

Виды возможных потерь от риска. Зоны и уровни последствий рискованных событий. Элементы общей модели оценки последствий риска. Классификация показателей оценки риска.

Математические модели оценки риска. Показатель риска. Основные требования при выборе показателей для оценки уровня риска. Соотношение доходности и риска. Основания качественной оценки риска. Содержание процесса количественной оценки риска.

Доходность и риск различных инвестиционных инструментов.

Система показателей оценки риска. Технология анализа и оценки риска.

Алгоритм реализации технологии риск-менеджмента.

Карта рисков: назначение, структура и содержание.

**Самостоятельная работа.** Анализ потерь и построение зоны риска.

Разработать проект:

1. Документа «Политика в области управления рисками» на примере конкретной организации.

2. Обобщенной Карты рисков на примере (ОАО «Лукойл», ОАО «РЖД», Северо-Западный банк ОАО «Сбербанк России» и др.)

**Рекомендуемая литература:**

основная [1,2];

дополнительная [1, 2].

### **Тема 6. Оценка риска в условиях определенности**

Виды основных детерминированных моделей оценки риска. Абсолютные показатели оценки риска.

Классификация активов предприятия на группы риска в зависимости от времени превращения в денежную форму по степени их ликвидности.

Оценка риска потери платежеспособности на основе абсолютных и относительных финансовых показателей.

Методика оценки потери платежеспособности. Сущность оценки риска финансовой устойчивости. Основные подходы к оценке риска на базе относительных показателей. Экономический смысл коэффициентов риска  $K_r$  и  $K_i$  по измерительной шкале.

Содержание финансовых коэффициентов ликвидности (платежеспособности). Содержание показателей финансовой устойчивости и независимости.

Комплексный коэффициент риска. Скорринг-оценка рисков.

**Самостоятельная работа.** Методика оценки потери платежеспособности.

**Рекомендуемая литература:**

основная [1,2];

дополнительная [1, 2].

### **Тема 7. Оценка риска в условиях частичной неопределенности**

Вероятностные показатели оценки риска. Кривая функции плотности нормального распределения. Условия возможных масштабов предпринимательских потерь и приемлемости риска.

Факторы, влияющие на оценку вероятности успеха проекта. Отличие интервальной оценки вероятности от точечной. Виды статистических показателей, используемых при оценке риска.

Показатель ожидаемого интегрального эффекта, используемый для сравнения и выбора различных инвестиционных проектов. Экономический смысл  $\sigma$  как интервала. Уровень доверительного интервала: понятие, назначение и примеры использования. Сущность и методика оценки рисков с

помощью методов VaR и Risk Metrics.

**Самостоятельная работа.** Интервальная оценка показателя риска.

**Рекомендуемая литература:**

основная [1,2];

дополнительная [1, 2].

### **Тема 8. Оценка риска в условиях неопределенности**

Нормативный подход к оценке риска. Сущность и содержание теории игр. Особенности оценки риска в ситуации неполной определенности. Оценка риска в ситуации полной определенности.

Матрица выигрышей  $E = ||e_{ij}||$  и матрица рисков  $R = ||r_{ij}||$ : принцип формирования и структура. Показатель, используемый в качестве критерия риска при выборе решения. Критерии, которые используются при принятии решений в условиях неопределенности.

Критерий оптимизма “максимакса”, используемый при выборе рискованных решений в условиях неопределенности. Критерий пессимизма при выборе рискованных решений в условиях неопределенности. Критерий Вальда при выборе рискованных решений в условиях неопределенности. Критерий Сэвиджа при выборе рискованных решений в условиях неопределенности. Критерий обобщенного максимина (пессимизма—оптимизма) Гурвица при выборе рискованных решений в условиях неопределенности. Принцип недостаточного обоснования Лапласа при выборе рискованных решений в условиях неопределенности.

Распределение Парето применительно к матричным играм. Эвристические правила оценки риска в условиях неопределенности.

**Самостоятельная работа.** Оптимальность по Парето в условиях неопределенности.

основная [1,2];

дополнительная [1, 2].

### **Тема 9. Экспертные методы и процедуры оценки риска**

Описательные модели анализа риска. Факторы, влияющие на рост степени риска. Структура матрицы SWOT-анализа. Сущность анализа макроэкономических факторов по методике PEST. Назначение и сущность аналитической модели GETS.

Условия использования эвристических методов. Виды традиционных эвристических процедур. Методы экспертной оценки риска. Технология экспертного оценивания. Математическая модель оценки компетентности эксперта (К). Графическая модель зависимости достоверности экспертизы от количества экспертов.

Методы коллективной работы экспертной группы. Основные цели использования индивидуальных экспертных оценок. Основные этапы включает общая схема экспертных опросов. Определение коэффициента конкордации.

Процедура проведения экспертной оценки риска методом Дельфи.

**Самостоятельная работа.** Характеристика экспертных процедур.

**Рекомендуемая литература:**

основная [1,2];

дополнительная [1, 2].

### **Тема 10. Оценка финансовых рисков**

Состав и структура хозяйственных рисков. Сущность финансовых рисков. Финансовые потоки внешней среды предприятия.

Сущность процентного риска. Последствия изменения процентных ставок. Зависимость процентного риска от подвижности процентной ставки. Нормальная кривая процентного дохода.

Нахождение будущей стоимости по простой процентной ставке. Особенности процентного риска облигаций. Математическая модель коэффициента покрытия процентов.

Факторы, способствующие возникновению кредитных рисков. Способы уменьшения кредитного риска. Соотношение реальной ставки доходности, номинальной процентной ставки и уровня доходности.

Определение темпа и индекса инфляции. Инфляционная премия.

**Самостоятельная работа.** Сущность финансовых рисков.

**Рекомендуемая литература:**

основная [1,2];

дополнительная [1, 2].

### **Тема 11. Комплексная оценка риска финансовой несостоятельности**

Характеристики риска финансовой несостоятельности. Модели оценки риска финансовой несостоятельности. Динамика развития и модели оценки риска финансовой несостоятельности.

Четырехфакторная модель рейтингового финансового анализа. Пятифакторная модель рейтингового финансового анализа. Двухфакторная модель Э. Альтмана. Пятифакторные модели Э. Альтмана.

Пятифакторная модель У. Бивера. Модель Лиса прогнозирования финансовой несостоятельности. Модель Таффлера прогнозирования финансовой несостоятельности.

Двухфакторная модель прогнозирования риска финансовой несостоятельности на основе отечественных источников. Четырехфакторная отечественная модель прогнозирования банкротства. Шестифакторная отечественная модель прогнозирования риска потери платежеспособности.

**Самостоятельная работа.** Модели прогнозирования риска финансовой несостоятельности на основе отечественных источников.

**Рекомендуемая литература:**

основная [1,2];

дополнительная [1, 2].

## **Тема 12. Оценка рисков инвестиционных проектов**

Особенности рисков инвестиционных проектов. Основные методы оценки уровня рисков инвестиционных проектов. Принципы и методические подходы, используемые в современной практике управления проектами.

Этапы анализ чувствительности проекта при оценке степени его риска. Коэффициент эластичности показателя эффективности проекта. Основные этапы анализа сценариев проекта. Система основных исходных (факторных) показателей, влияющих на формирование эффективности проекта.

Сущность метода имитационного моделирования (метод Монте-Карло) оценки проектного риска. Основные задачи метода “дерева решений” (“дерева вероятностей”) оценки проектного риска.

Оценка эффективности мер по снижению рисков инвестиционных проектов.

**Самостоятельная работа.** Оценка эффективности мер по снижению рисков инвестиционных проектов.

### **Рекомендуемая литература:**

основная [1,2];

дополнительная [1, 2].

## **Тема 13. Оценка специфических рисков**

Экологические последствия техногенных воздействий на окружающую среду при осуществлении хозяйственной деятельности. Оценка воздействия на окружающую среду. Зависимость, определяющая эколого-экономический риск при эксплуатации экологически опасных объектов. Стандарты в сфере «системы экологического менеджмента». Классификацию мер по управлению экологическими рисками, осуществляемых на государственном уровне. Состав и структура механизмов экологического регулирования. Виды экономической ответственности за экологические правонарушения.

Оценка пожарного риска на производственном объекте. Методика расчета основных величин индивидуального пожарного риска. Определение частоты реализации пожароопасных ситуаций. Построение полей опасных факторов пожара для различных сценариев его развития. Учет наличия систем обеспечения пожарной безопасности здания. Оценка пожарного риска на производственном объекте.

Методика расчета основных величин индивидуального пожарного риска. Модели и методы оценки странового риска. Особенности оценки странового риска по методике Мирового банка.

**Самостоятельная работа.** Страновые риски, их оценка.

### **Рекомендуемая литература:**

основная [1,2];

дополнительная [1, 2].

## **Тема 14. Механизмы нейтрализации риска в материально-техническом обеспечении**

Определение управления риском (риск-менеджмента). Этапы процесса управления риском в материально-техническом обеспечении. Основные принципы управления риском. Постулаты риск-менеджмента. Требования к процессу управления риском.

Механизмы нейтрализации рисков в материально-техническом обеспечении. Методы и средства разрешения рисков. Основные меры уклонения от риска. Основные направления передачи рисков. Возможности использования факторинга для управления риском в материально-техническом обеспечении.

Цели и основные методы снижения уровня риска. Сущность распределения (диссипации) риска в материально-техническом обеспечении.

Варианты лимитирования рисков в материально-техническом обеспечении. Основные формы самострахования. Оценка эффективности мероприятий по управлению рисками в материально-техническом обеспечении.

**Самостоятельная работа.** Контроль и оценка эффективности мероприятий по управлению рисками в материально-техническом обеспечении.

#### **Рекомендуемая литература:**

основная [1,2];

дополнительная [1, 2].

### **5. Методические рекомендации по организации изучения дисциплины**

При реализации программы дисциплины используется лекционное и практическое занятия.

Общими целями занятий являются:

- обобщение, систематизация, углубление, закрепление теоретических знаний по конкретным темам дисциплины;
- формирование умений применять полученные знания на практике, реализация единства интеллектуальной и практической деятельности;
- выработка при решении поставленных задач профессионально значимых качеств: самостоятельности, ответственности, точности, творческой инициативы.

Целями лекции являются:

- дать систематизированные научные знания по дисциплине, акцентировав внимание на наиболее сложных вопросах;
- стимулировать активную познавательную деятельность обучающихся, способствовать формированию их творческого мышления.

В ходе практического занятия обеспечивается процесс активного взаимодействия обучающихся с преподавателем; приобретаются практические навыки и умения. Цель практического занятия: углубить и закрепить знания, полученные на лекции; формирование навыков использования знаний для решения практических задач; выполнение тестовых заданий по проверке полученных знаний и умений.

Самостоятельная работа обучающихся направлена на углубление и закрепление знаний, полученных на лекциях и других занятиях, выработку

навыков самостоятельного активного приобретения новых, дополнительных знаний, подготовку к предстоящим занятиям.

## **6. Оценочные материалы по дисциплине**

Текущий контроль успеваемости обеспечивает оценивание хода освоения дисциплины, проводится в соответствии с содержанием дисциплины по видам занятий в форме опроса, докладов, тестирования.

Промежуточная аттестация обеспечивает оценивание промежуточных и окончательных результатов обучения по дисциплине, проводится в форме ответа на вопросы.

### **6.1. Примерные оценочные материалы текущего контроля**

#### **Типовые вопросы для опроса:**

1. Назовите механизмы нейтрализации рисков?
2. Какие Вы знаете особенности рисков инвестиционных проектов?
3. В чем сущность процентного риска?

#### **Типовые темы для докладов:**

1. Факторы, влияющие на оценку вероятности успеха проекта.
2. Карта рисков: назначение, структура и содержание.
3. Виды опасности по источнику возникновения.

#### **Типовые задания для тестирования:**

1. Форма финансирования, которая предусматривает распределение всех рисков проекта между его участниками, называется:
  - a) финансирование без права регресса;
  - b) финансирование с полным регрессом;
  - c) финансирование с ограниченным правом регресса.
2. При анализе и оценке рисков проекта используется:
  - a) метод критического пути;
  - b) метод дерева решений;
  - c) симплекс-метод.
3. Снизить риски проекта позволяет:
  - a) предоставление гарантий и залогов;
  - b) метод сбалансированных показателей;
  - c) создание резервов.

### **6.2. Примерный перечень вопросов для зачета оценкой**

1. Характеристика основных понятий - «риск», «вероятность», «неопределенность», «менеджмент риска».
2. Понятия «неопределенность» и «риск», их соотнесение между собой.
3. Понятия «опасность», «угроза», «уязвимость», «ущерб» и «риск», их соотнесение между собой.
4. Основные черты риска.
5. Основные причины неопределенности и источников риска.
6. Риски в материально-техническом обеспечении.

7. Классификация рискообразующих факторов экономического риска.
8. Классификация рисков в материально-техническом обеспечении.
9. Основные идеи классической теории рисков.
10. Сущность экономической парадигмы маржиналистов.
11. Риски и инновационные инвестиции, их соотнесение между собой согласно марксистского учения о рисках.
12. Вклад Дж. Кейнса в неоклассическую теорию риска.
13. Подходы к оценке роли предпринимателей в теории институциональной теории рисков.
14. Основные аксиомы управления рисками.
15. Закон единства систем управления для риск-менеджмента.
16. Закон зависимости доходов и риска.
17. Виды опасности по источнику возникновения.
18. Виды опасностей в материально-техническом обеспечении по масштабу.
19. Формы проявления опасности для функционирования организации.
20. Соотношения последствий и ущерба.
21. Особенности прямого, косвенного, полного и общего ущерба.
22. Основные проявления человеческого фактора при оценке риска.
23. Влияние социотехногенных факторов на риск.
24. Факторы, оказывающие воздействие на вероятность ошибок в работе персонала.
25. Управление риском (риск-менеджмент): понятие, цель, задачи и функции.
26. Система управления риском в материально-техническом обеспечении.
27. Основные принципы управления риском.
28. Характеристика видов возможных потерь.
29. Ведущие международные и отечественные рейтинговые агентства: их роль в оценке риска.
30. Технология управления риском как трехэтапный процесс мероприятий.
31. Стратегия риск-менеджмента в материально-техническом обеспечении.
32. Сущность тактики риск-менеджмента.
33. Алгоритм управления риском в системе управления предприятием.
34. Организационная структура, реализующая функции риск-менеджмента.
35. Виды возможных потерь от риска.
36. Зоны и уровни последствий рискованных событий.
37. Элементы общей модели оценки последствий риска.
38. Классификация показателей оценки риска в материально-техническом обеспечении.
39. Основные требования при выборе показателей для оценки уровня риска.
40. Основания качественной оценки риска.

41. Содержание процесса количественной оценки риска.
42. Карта рисков: назначение, структура и содержание.
43. Виды основных детерминированных моделей оценки риска.
44. Классификация активов предприятия на группы риска в зависимости от времени превращения в денежную форму по степени их ликвидности.
45. Оценка риска потери платежеспособности на основе абсолютных и относительных финансовых показателей.
46. Методика оценки потери платежеспособности.
47. Сущность оценки риска финансовой устойчивости.
48. Основные подходы к оценке риска на базе относительных показателей.
49. Экономический смысл коэффициентов риска  $K_p$  и  $K_i$  по измерительной шкале.
50. Содержание финансовых коэффициентов ликвидности (платежеспособности).
51. Содержание показателей финансовой устойчивости и независимости.
52. Кривая функции плотности нормального распределения.
53. Условия возможных масштабов предпринимательских потерь и приемлемости риска.
54. Факторы, влияющие на оценку вероятности успеха проекта.
55. Отличие интервальной оценки вероятности от точечной.
56. Виды статистических показателей, используемых при оценке риска
57. Показатель ожидаемого интегрального эффекта, используемый для сравнения и выбора различных инвестиционных проектов.
58. Экономический смысл  $\sigma$  как интервала.
59. Сущность и методика оценки рисков с помощью методов VaR и Risk Metrics.
60. Уровень доверительного интервала: понятие, назначение и примеры использования.

### 6.3. Показатели и критерии оценивания

Система оценивания включает следующие оценки: «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно».

Оценочные средства	Показатели оценивания	Критерии оценивания	Оценка
опрос (ответ)	правильность и полнота ответа	дан правильный, полный ответ на поставленный вопрос, показана совокупность осознанных знаний по дисциплине, доказательно раскрыты основные положения вопросов; могут быть допущены недочеты, исправленные самостоятельно в процессе ответа.	отлично
		дан правильный, недостаточно полный ответ на поставленный	хорошо

		вопрос, показано умение выделить существенные и несущественные признаки, причинно-следственные связи; могут быть допущены недочеты, исправленные с помощью преподавателя.	
		дан недостаточно правильный и полный ответ; логика и последовательность изложения имеют нарушения; в ответе отсутствуют выводы.	удовлетворительно
		ответ представляет собой разрозненные знания с существенными ошибками по вопросу; присутствуют фрагментарность, нелогичность изложения; дополнительные и уточняющие вопросы не приводят к коррекции ответа на вопрос.	неудовлетворительно
доклад	содержание, полнота и представление доклада	содержание заданной темы раскрыто в полном объеме с использованием компьютерных технологий (презентация); отражена структура доклада (вступление, основная часть, заключение, присутствуют выводы и примеры).	отлично
		содержание заданной темы раскрыто не в полном объеме с использованием компьютерных технологий (презентация); отражена структура доклада (вступление, основная часть, заключение, присутствуют выводы).	хорошо
		содержание заданной темы раскрыто не в полном объеме без использования компьютерных технологий (презентация); структура доклада отражена не в полном объеме (основная часть, заключение).	удовлетворительно
		содержание заданной темы не раскрыто; не использованы компьютерные технологии (презентация); структура доклада не отражена.	неудовлетворительно
тестирование	процент правильных ответов	более 80%	отлично
		более 60% до 80%	хорошо
		более 40% до 60%	удовлетворительно
		40% и менее	неудовлетворительно

## 7. Ресурсное обеспечение дисциплины

### 7.1. Программное обеспечение

Перечень программного обеспечения для реализации дисциплины, в том числе лицензионного:

- Microsoft Windows 7 Professional – Системное программное обеспечение. Операционная система. [Коммерческая (Volume Licensing)]; ПО-72В-264;

- Microsoft Windows 8 Professional – Системное программное обеспечение. Операционная система. [Коммерческая (Volume Licensing)]; ПО-842-573;

- Microsoft Windows Professional, Russian – Системное программное обеспечение. Операционная система. [Коммерческая (Volume Licensing)]; ПО-ВЕ8-834;

- Microsoft Office Standard (Word, Excel, Access, PowerPoint, Outlook, OneNote, Publisher) – Пакет офисных приложений [Коммерческая (Volume Licensing)]; ПО-D86-664;

- Adobe Acrobat Reader DC – Приложение для создания и просмотра электронных публикаций в формате PDF [Бесплатная]; ПО-F63-948;

- 7-Zip – Файловый архиватор [Бесплатная]; ПО-F33-948;

- Apache OpenOffice – Пакет офисных приложений [Открытая]; ПО-ЕВ7-115;

- Google Chrome – Браузер [Открытая]; ПО-F2С-926;

- LibreOffice – Пакет офисных приложений [Открытая]; ПО-СВВ-979;

- Альт Образование 8 – Системное программное обеспечение. Операционная система. [Открытая]; ПО-534-102.

## **7.2. Профессиональные базы данных и информационно-справочные системы**

Информационно-справочная система — Сервер органов государственной власти Российской Федерации <http://россия.рф/> (свободный доступ); базы данных — Портал открытых данных Российской Федерации <https://data.gov.ru/> (свободный доступ); федеральный портал «Российское образование» <http://www.edu.ru> (свободный доступ); система официального опубликования правовых актов в электронном виде <http://publication.pravo.gov.ru/> (свободный доступ); федеральный портал «Совершенствование государственного управления» <https://ar.gov.ru> (свободный доступ); электронная библиотека университета <http://elib.igps.ru> (авторизованный доступ); электронно-библиотечная система «ЭБС IPR BOOKS» <http://www.iprbookshop.ru> (авторизованный доступ).

## **7.3. Литература**

### **а) Основная литература:**

1. Оценка рисков в проектном менеджменте [Электронный ресурс] : учебное пособие / Е. И. Капустина, О. П. Григорьева, Ю. С. Скрипниченко [и др.]. — Электрон. текстовые данные. — Ставрополь : Ставропольский государственный аграрный университет, 2017. — 152 с. — 2227-8397. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/76047.html>

2. Дубина, И. Н. Основы управления рисками : учебное пособие / И.

Н. Дубина, Г. К. Кишибекова. — Саратов : Вузовское образование, 2018. — 266 с. — ISBN 978-5-4487-0271-6. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/76240.html>

**Дополнительная литература:**

1. Иванов, А. А. Риск-менеджмент [Электронный ресурс] : учебное пособие / А. А. Иванов, С. Я. Олейников, С. А. Бочаров. — Электрон. текстовые данные. — М. : Евразийский открытый институт, 2011. — 304 с. — 978-5-374-00013-6. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/10817.html>

2. Кулешова, Е. В. Управление рисками проектов [Электронный ресурс] : учебное пособие / Е. В. Кулешова. — 2-е изд. — Электрон. текстовые данные. — Томск : Томский государственный университет систем управления и радиоэлектроники, Эль Контент, 2015. — 188 с. — 978-5-4332-0251-1. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/72205.html>

#### **7.4. Материально-техническое обеспечение**

Для проведения и обеспечения занятий используются специальные помещения, представляющие собой учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа, занятий практического типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, а также помещения для самостоятельной работы.

Для проведения занятий лекционного типа используются наборы демонстрационного оборудования и учебно-наглядных пособий, обеспечивающие тематические иллюстрации.

**Авторы:** доктор экономических наук, профессор Бардулин Е.Н.,  
доктор военных наук, профессор Бабенков В.И.