

МИНОБРНАУКИ РОССИИ  
Федеральное государственное бюджетное  
образовательное учреждение высшего образования  
«Костромской государственный университет»

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ  
ОЦЕНКА РИСКОВ**

Направление подготовки «38.03.02 Менеджмент»  
Направленность «Менеджмент»  
Квалификация выпускника: бакалавр

Кострома  
2020

Рабочая программа дисциплины «Оценка Рисков» разработана в соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент организации, Приказ Минобрнауки России №7 от 12.01.2016.

Разработал:  Илюхина А. С., зав. каф. бизнес-информатики и сервиса, доцент.

подпись

Рецензент:  Алхасова Ирина Владимировна, к.э.н., доцент

УТВЕРЖДЕНО:

На заседании кафедры Менеджмента и маркетинга

Протокол заседания кафедры № 9 от 08.05 2020г.

Заведующий кафедрой  Гуляева М.К., к.э.н. доцент

## Цели и задачи освоения дисциплины

Цель дисциплины: формирование у студентов теоретических и практических основ оценки рисков в предпринимательской деятельности, овладение инструментарием для выявления и анализа рисков.

Задачи дисциплины:

- получение представления об анализе и оценке рисков;
- дать понимание цели, задач и особенности оценки рисков;
- овладение методами и подходами к оценке рисков на основе базовых понятий теории вероятностей и математической статистики;
- освоить методы статистического анализа и прогнозирования случайных процессов;
- научить использовать основные методы естественнонаучных дисциплин в профессиональной деятельности для теоретического и экспериментального исследования.

## 2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине

В результате освоения дисциплины обучающийся должен:

**знать:**

- методы и подходы к оценке рисков;
- базовые понятия теории вероятностей и математической статистики;
- соответствующий математический аппарат и инструментальные средства для обработки, анализа и систематизации информации по теме исследования;

**уметь:**

- применять методы и подходы к оценке рисков в ходе профессиональной деятельности;
- использовать математические инструментальные средства для обработки, анализа и систематизации информации;
- применять соответствующий математический аппарат и инструментальные средства для обработки, анализа и систематизации информации по теме исследования.

**владеть:**

навыками решения вероятностных задач, использования методов математики при решении задач социально-экономического содержания, использования специальных современных статистических методов.

**освоить компетенции:**

ОПК-5 – владением навыками составления финансовой отчетности с учетом последствий влияния различных методов и способов финансового учета на финансовые результаты деятельности организации на основе использования современных методов обработки деловой информации и корпоративных информационных систем ;

ПК-9 – способностью оценивать воздействие макроэкономической среды на функционирование организаций и органов государственного и муниципального управления, выявлять и анализировать рыночные и специфические риски, а также анализировать поведение потребителей экономических благ и формирование спроса на основе знания экономических основ поведения организаций, структур рынков и конкурентной среды отрасли ;

ПК-15 – умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании .

## 3. Место дисциплины в структуре ОП ВО

Дисциплина относится к базовой части учебного плана. Изучается в 4 семестре обучения. Изучение дисциплины основывается на ранее освоенных дисциплинах: курс элементарной математики среднего образовательного учреждения и успешное освоение дисциплин "Математика", "Экономическая теория", "Менеджмент организации" учебного плана. Изучение дисциплины является основой для освоения последующих дисциплин: Анализ данных .

## 4. Объем дисциплины (модуля)

### 4.1. Объем дисциплины в зачетных единицах с указанием академических (астрономических) часов и виды учебной работы

Виды учебной работы,	Заочная форма
Общая трудоемкость в зачетных единицах	3
Общая трудоемкость в часах	108
Аудиторные занятия в часах, в том числе:	10
Лекции	4
Практические занятия	6
Лабораторные занятия	
Самостоятельная работа в часах	93,75
ИКР	0,25
Контроль	4
Форма промежуточной аттестации	зачет

### 4.2. Объем контактной работы на 1 обучающегося

Виды учебных занятий	Очная форма
Лекции	4
Практические занятия	6
Лабораторные занятия	
Консультации (на группу)	
Зачет/зачеты (ИКР)	0,25
Экзамен/экзамены	–
Курсовые работы	–
Курсовые проекты	–
Всего	10,25

## 5. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам), с указанием количества часов и видов занятий

### 5.1 Тематический план учебной дисциплины

№	Название раздела, темы	Всего з.е./час.	Аудиторные занятия			Самостоятельная ~
			Лекц.	Практ.	Лаборат.	
1	Элементы комбинаторики	27	1	1		25
2	Случайные события	27	1	1		25
3	Случайные величины	28	1	2		25
4	Элементы математической статистики	21,75	1	2		18,75
5	ИКР	0,25				0,25
6	Подготовка к зачету	4				4
7	Итого:	108	4	6		98

### 5.2. Содержание:

**Раздел 1. Элементы комбинаторики.** Понятие выборки. Основные комбинаторные конфигурации: сочетания, размещения и перестановки.

**Раздел 2. Случайные события.** Методы и подходы к оценке рисков. Виды событий и действия над ними. Статистическое, классическое и геометрическое определения вероятности случайного события. Основные теоремы теории вероятностей. Формула полной вероятности и формула Байеса. Повторные испытания Бернулли. Асимптотические формулы в схеме Бернулли.

**Раздел 3. Случайные величины.** Дискретные и непрерывные случайные величины, способы задания. Числовые характеристики случайных величин. Важнейшие распределения случайных величин. Предельные теоремы теории вероятностей.

**Раздел 4. Элементы математической статистики.** Генеральная и выборочная совокупность. Статистическое распределение выборки. Графическое представление распределений. Статистическая оценка параметров распределения. Проверка гипотез о соответствии статистических данных теоретическому закону распределения.

### 6. Методические материалы для обучающихся по освоению

## ДИСЦИПЛИНЫ

### 6.1. Самостоятельная работа обучающихся по дисциплине (модулю)

№ п/п	Раздел (тема) дисциплины	Задание	Часы	Методические рекомендации по выполнению задания (Литература)	Форма контроля
	<b>4 семестр</b>		<b>54</b>		
1	Элементы комбинаторики	Изучение теоретического материала.	25	[1], [2]	Опрос на практическом занятии, зачёт
		Выполнение д/з.	25	[1], [4]	Разбор домашних заданий
2	Случайные события	Изучение теоретического материала лекций.	25	Лекционный материал, [1], [3]	Опрос на практическом занятии, экзамен
		Выполнение д/з.	18,75	Лекционный материал, [1], [4]	Разбор домашних заданий
		Подготовка к контрольной работе № 1 по теме "Случайные события".	0,25	Лекционный материал, [3], [4]	Контрольная работа
3	Случайные величины	Изучение теоретического материала лекций.	4	Лекционный материал, [1], [3]	Опрос на практическом занятии, экзамен
		Выполнение д/з.	98	Лекционный материал, [1], [4]	Разбор домашних заданий
		Подготовка к контрольной работе № 2 по теме «Случайные функции».	25	Лекционный материал, [3], [4]	Контрольная работа
4	Элементы математической статистики	Изучение теоретического материала лекций.	25	Лекционный материал, [1], [2], [3]	Опрос на практическом занятии, экзамен
		Выполнение д/з.	25	Лекционный материал, [5], [6]	Разбор домашних заданий
		Выполнение индивидуального домашнего задания по теме «Статистическая обработка экспериментальных данных».	18,75	Лекционный материал, [1], [2], [5], [6]	Защита индивидуального задания
5	Подготовка к зачету.		4	Лекционный материал, [1], [2], [3], [4], [7], [8]	зачет
6	ИКР		0,25		
7	<b>Итого:</b>		98		

### 6.2. Тематика и задания для практических занятий

№ занят.	Тема практического занятия	Задания для практического занятия
<b>4 семестр</b>		
<b>Литература</b> , необходимая для занятий: <i>Лунгу К.Н. Сборник задач по высшей математике. М.: Айрис Пресс, 2017, Т.2 [4]; Математическая статистика. Теория и практика: учебное пособие/И.В.Землякова, О.Б.Садовская, А.В.Чередникова. - Кострома: Изд-во Костром.гос.технол.ун-та, 2010.-58с. - ISBN 978-5-8285-0525-8 [7]</i>		
1	Комбинаторика	[4]: 6.1.1–6.1.4; 6.1.6; 6.1.10–6.1.12; 6.1.15; 6.1.17; 6.1.18; 6.1.25; 6.1.30; 6.1.31; 6.1.36.
2–4	Случайные события	[4]: 6.3.1–6.3.6; 6.3.14; 6.3.18; 6.4.12; 6.4.14–6.4.17; 6.4.19; 6.4.21; 6.4.22; 6.4.25; 6.5.1–6.5.5; 6.5.9; 6.5.12; 6.5.13; 6.6.1–6.6.5; 6.5.7; 6.4.31; 6.4.38; 6.4.39; 6.7.1–6.7.5; 6.7.7–6.7.10; 6.7.13; 6.7.28.
5-7	Случайные величины	[4]: 6.8.1–6.8.6; 6.8.7–6.8.11; 6.9.1–6.9.3; 6.9.10; 6.9.11; 6.10.1–6.10.4; 6.10.7; 6.10.8; 6.10.12; 6.10.14; 6.10.15; 6.10.22; 6.11.14; 6.11.14; 6.11.16; 6.11.24; 6.11.25.
8	Математическая статистика	[7]: Индивидуальные задания №1-3 стр.44-45.

### 6.3. Тематика и задания для лабораторных занятий

Лабораторные занятия отсутствуют.

### 6.4. Методические рекомендации для выполнения курсовых работ

**(проектов) при наличии**  
Курсовые работы отсутствуют.

### 7. Перечень основной и дополнительной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

№ п/п	Литература	Кол-во книг
<i>Основная</i>		
1	Теория вероятностей и математическая статистика: Учебное пособие / Бирюкова Л.Г., Бобрик Г.И., Матвеев В.И., - 2-е изд. - М.:НИЦ ИНФРА-М, 2017. - 289 с.: 60х90 1/16. - (Высшее образование: Бакалавриат) ISBN 978-5-16-011793-5 - <a href="http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=370899">http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=370899</a>	
2	Гулай, Т.А. Теория вероятностей и математическая статистика [Электронный ресурс] : учебное пособие / Т.А. Гулай, А.Ф. Долгополова, Д.Б. Литвин, С.В. Мелешко. - 2-е изд., доп. – Ставрополь: АГРУС, 2013. - 260 с. - Режим доступа: <a href="http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=514780">http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=514780</a>	
3	Балдин, К.В. Теория вероятностей и математическая статистика : учебник / К.В. Балдин, В.Н. Башлыков, А.В. Рукоусев. - 2-е изд. - Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2016. - 472 с. : ил. - Библиогр.: с. 433-434. - ISBN 978-5- 394-02108-4 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <a href="http://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=453249">http://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=453249</a>	
4	Лунгу К.Н. Сборник задач по высшей математике с контрольными работами: учеб. пособие. 2 курс / под ред. С. Н. Федина. – 4-е изд.; 5-е изд. – Москва: Айрис-пресс, 2006; 2007. – 592 с.: ил. – (Выш. образование). – МО РФ. – ЕН. – ISBN 978-5-8112-2486-9: 122.00.	146
<i>Дополнительная</i>		
5	Теория вероятностей, математическая статистика в примерах, задачах и тестах: Учебное пособие. / Сапожников П.Н., Макаров А.А., Радионова М.В. - М.:КУРС, НИЦ ИНФРА-М, 2016. - 496 с.: 60х90 1/16. - (Бакалавриат и магистратура) (Переплёт 7БЦ) ISBN 978-5-906818-47-8	
6	Березинец, И. В. Практикум по теории вероятностей и математической статистике / И. В. Березинец; Высшая школа менеджмента СПбГУ. — 9-е изд., испр. и доп. — СПб.: Изд-во «Высшая школа менеджмента», 2013 — 163 с. - ISBN 978-5-9924-0088-5 - <a href="http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=492718">http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=492718</a>	
7	Землякова И.В. Математическая статистика. Теория и практика: учебное пособие/И.В.Землякова, О.Б.Садовская, А.В.Чередникова. - Кострома: Изд-во Костром.гос.технол.ун-та, 2010.-58с. - ISBN 978-5-8285-0525-8	130
8	Теория вероятностей: Учебное пособие / И.А. Палий. - М.: ИНФРА-М, 2012. - 236 с.: 60х90 1/16. - (Высшее образование). ISBN 978-5-16-004940-3 - <a href="http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=225156">http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=225156</a>	

### 8. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины

1. Библиотека КГУ <http://library.ksu.edu.ru/>
2. ЭБС «Университетская библиотека online» <http://biblioclub.ru>
3. ЭБС «Znanium» <http://znanium.com/>
4. Консультант Студента. Электронная библиотека технического вуза <http://www.studentlibrary.ru/>

### 9. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине

Для проведения занятий по дисциплине необходимы учебная аудитория, доска, мел (маркеры для доски), проектор, компьютер (ноутбук), компьютерный класс.