

Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«Российский государственный гуманитарный университет»
(ФГАОУ ВО «РГГУ»)

ИНСТИТУТ СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ НАУК
ЭКОНОМИЧЕСКИЙ ФАКУЛЬТЕТ

Кафедра социально-экономической статистики и демографии

СТАТИСТИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ РИСКОВ

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

01.03.05 Статистика

38.03.01 Экономика

Код и наименование направления подготовки/специальности

Социально-экономическая статистика и демография

Наименование направленности (профиля)/ специализации

Уровень высшего образования: *бакалавриат*

Форма обучения: *очная*

РПД адаптирована для лиц
с ограниченными возможностями
здоровья и инвалидов

Москва 2026

Статистический анализ рисков

Рабочая программа дисциплины

Составитель:

Докт. экон. наук, доц. Сопилко Н.Ю.

по материалам кафедры социально-экономической статистики и демографии

УТВЕРЖДЕНО:

Протокол заседания кафедры

№8 от 25.12. 2025 года

ОГЛАВЛЕНИЕ

1	Пояснительная записка.....	4
1.1	Цель и задачи дисциплины.....	4
1.2	Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с индикаторами достижения компетенций.....	4
1.2	Место дисциплины в структуре образовательной программы.....	6
2	Структура дисциплины.....	6
3	Содержание дисциплины.....	6
4	Образовательные технологии.....	8
5	Оценка планируемых результатов обучения.....	8
5.1	Система оценивания.....	8
5.2	Критерии выставления оценки по дисциплине.....	9
5.3	Оценочные средства (материалы) для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине.....	11
6	Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины.....	12
6.1	Список литературы.....	12
6.2	Перечень ресурсов информационно-коммуникационной среды “Интернет”.....	12
6.3	Профессиональные базы данных и информационно-справочные системы.....	12
7	Материально-техническое обеспечение дисциплины.....	13
8	Обеспечение образовательного процесса для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов.....	14
9	Методические материалы.....	15
9.1	Планы практических занятий.....	15
9.2	Методические рекомендации по подготовке письменных работ.....	16
	Приложение 1	17

1 Пояснительная записка

1.1 Цель и задачи дисциплины

Цель дисциплины – формирование знаний, умений, навыков в области статистического анализа рисков при проведении статистических исследований социально-экономических явлений и процессов.

Задачи дисциплины:

1. Изучение методологии статистического исследования рисков.
2. Умение использовать основные принципы анализа статистических данных для решения задач исследования рисков.
3. Умение выявлять и ранжировать внешние и внутренние факторы, а также влияние заинтересованных сторон как источники рисков событий.
4. Владение методиками анализа рисков и основными подходами в формировании аналитических материалов на основе проведенного анализа.

1.2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с индикаторами достижения компетенций

Компетенция (код и наименование)	Индикаторы компетенций (код и наименование)	Результаты обучения
ПК-3 Способен формировать системы взаимосвязанных статистических показателей с целью анализа изучаемых явлений и процессов	ПК-3.1 Определяет основные подходы подбора исходных показателей для осуществления анализа явлений и процессов ПК-3.2 Проводит расчет агрегированных и производных статистических показателей ПК-3.3 Подготавливает на основе проведенных расчетов аналитические материалы	Знать - методологию статистического исследования рисков; - виды зависимостей: функциональная, статистическая и корреляционная зависимости; основные положения регрессионного анализа; - теоретические подходы к формированию инструментальной базы расчетов при подготовки аналитических материалов. Уметь - использовать основные принципы анализа статистических данных для решения задач исследования рисков; - анализировать и содержательно интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики в области экономики, критически оценивать результаты и/или тенденции изменения социально-экономических показателей; - выявлять и ранжировать внешние и внутренние факторы, а также влияние заинтересованных сторон как источники рисков событий. Владеть - методиками анализа рисков и основными подходами в формировании аналитических материалов на основе проведенного анализа - навыками статистического анализа и интерпретации информации, содержащейся в различных отечественных и зарубежных

		источниках; - навыками применения практических методов качественной и количественной оценки рисков.
--	--	--

1.2 Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Статистический анализ рисков» относится к дисциплинам, формируемым участниками образовательных отношений.

Для освоения дисциплины необходимы знания, умения и владения, сформированные в ходе изучения следующих дисциплин: «Теория вероятностей и математическая статистика», «Анализ временных рядов и прогнозирование», «Теория статистики», «Интеллектуальный анализ статистических данных», «Многомерные статистические методы».

В результате освоения дисциплины формируются знания, умения и владения, необходимые для изучения следующих дисциплин: «Оценка и управление рисками», «Макроэкономическая статистика».

2 Структура дисциплины

Структура дисциплины для очной формы обучения

Общая трудоёмкость дисциплины составляет 3 з.е., 108 ч., в том числе контактная работа обучающихся с преподавателем 42 ч., самостоятельная работа обучающихся 66 ч.

Семестр	Тип учебных занятий	Количество часов
8	Лекция	18
8	Семинар	24
Всего:		42

3 Содержание дисциплины

№	Наименование раздела дисциплины	Содержание
1	Теоретические основы анализа и оценка рисков	Понятие риска и принципы управления рисками в системе рыночных отношений организации. Сущность и классификация рисков. Этапы и причины возникновения рисков. Источники информации при анализе рисков. Основные принципы управления рисками. Оптимизация хозяйственных связей, обеспечение информационных потоков между субъектами хозяйственного процесса. Понятие риска в абсолютном и относительном выражении.
2	Виды и факторы экономических рисков	Понятие предпринимательского и потребительского риска. Многообразие предпринимательских рисков и проблемы их классификации. Общая и целевые классификации предпринимательских рисков. Основные классификации рисков предприятия: по типу и отраслевой направленности предпринимательства; по стадиям осуществления бизнес-идеи; по степени (уровню) риска, по причинам (условиям) возникновения риска; по сфере возникновения (внутренние и внешние)

		риска; по длительности во времени; по степени правомерности; по уровню действия; по возможности страхования; по возможности управления. Динамические и статические риски. Простые и составные риски. Сущность и факторы риска: в производственном и коммерческом предпринимательстве; в банковском и страховом бизнесе; в инновационном предпринимательстве и других сферах экономики. Основные факторы предпринимательских рисков в современной российской экономике.
3	Риск как статистическая категория	Статистические принципы классификации рисков. Тенденции развития риск-менеджмента. Сущность статистического анализа в задаче риск-менеджмента. Основные разновидности финансовых рисков. Статистическая оценка рисков. Основные механизмы управления рисками.
4	Методология статистического исследования бизнес-рисков	Сбор и статистическая обработка данных. Анализ риска (качественный и количественный). Статистическая оценка приемлемости риска.
5	Статистические показатели оценки рисков бизнес-проектов	Критерии оценки инвестиционных проектов и их роль в статистическом анализе проектных рисков. Риски инноваций. Ожидаемая доходность и вариация. Метод построения дерева решений.
6	Моделирование бизнес-рисков на основе статистико-математических моделей	Метод анализа рисков без учета распределения вероятностей. Вероятностно-теоретические и выборочные методы. Метод Монте – Карло. Анализ неопределенности и чувствительности. Определение возможного разброса данных. Оценка вероятностей. Установление корреляционных связей. Проведение имитаций. Анализ результатов.
7	Анализ и оценка экономических рисков на предприятии	Использование бухгалтерских отчетов в анализе рисков. Динамика развития финансовой несостоятельности. Состав моделей оценки риска. Группировки активов и пассивов баланса по уровню риска ликвидности. Способы оценки риска ликвидности. Анализ и оценка риска ликвидности с использованием абсолютных показателей по балансу. Анализ и оценка риска ликвидности по балансу с использованием относительных показателей. Риск потери устойчивости в моделях оценки риска. Анализ комплексных методов оценки состоятельности организации. Риск потери финансовой устойчивости и независимости. Риск банкротства

4 Образовательные технологии

Для проведения учебных занятий по дисциплине используются различные образовательные технологии. Для организации учебного процесса может быть использовано электронное обучение и (или) дистанционные образовательные технологии.

5 Оценка планируемых результатов обучения

5.1 Система оценивания

Форма контроля	Макс. количество баллов	
	За одну работу	Всего
Текущий контроль: - защита отчета по практической работе	12 баллов	60 баллов
Промежуточная аттестация: зачет с оценкой		40 баллов
Итого за семестр		100 баллов

Полученный совокупный результат конвертируется в традиционную шкалу оценок и в шкалу оценок Европейской системы переноса и накопления кредитов (European Credit Transfer System; далее – ECTS) в соответствии с таблицей:

100-балльная шкала	Традиционная шкала		Шкала ECTS
95 – 100	отлично	зачтено	A
83 – 94			B
68 – 82	хорошо		C
56 – 67	удовлетворительно		D
50 – 55			E
20 – 49	неудовлетворительно	не зачтено	FX
0 – 19			F

5.2 Критерии выставления оценки по дисциплине

Баллы/ Шкала ECTS	Оценка по дисциплине	Критерии оценки результатов обучения по дисциплине
100-83/ A,B	«отлично»/ «зачтено (отлично)»/ «зачтено»	Выставляется обучающемуся, если он глубоко и прочно усвоил теоретический и практический материал, может продемонстрировать это на занятиях и в ходе промежуточной аттестации. Обучающийся исчерпывающе и логически стройно излагает учебный материал, умеет увязывать теорию с практикой, справляется с решением задач профессиональной направленности высокого уровня сложности, правильно обосновывает принятые решения. Свободно ориентируется в учебной и профессиональной литературе. Оценка по дисциплине выставляется обучающемуся с учётом результатов текущей и промежуточной аттестации. Компетенции, закреплённые за дисциплиной, сформированы на уровне – «высокий».

Баллы/ Шкала ECTS	Оценка по дисциплине	Критерии оценки результатов обучения по дисциплине
82-68/ С	«хорошо»/ «зачтено (хорошо)»/ «зачтено»	Выставляется обучающемуся, если он знает теоретический и практический материал, грамотно и по существу излагает его на занятиях и в ходе промежуточной аттестации, не допуская существенных неточностей. Обучающийся правильно применяет теоретические положения при решении практических задач профессиональной направленности разного уровня сложности, владеет необходимыми для этого навыками и приёмами. Достаточно хорошо ориентируется в учебной и профессиональной литературе. Оценка по дисциплине выставляется обучающемуся с учётом результатов текущей и промежуточной аттестации. Компетенции, закреплённые за дисциплиной, сформированы на уровне – «хороший».
67-50/ D,E	«удовлетвори- тельно»/ «зачтено (удовлетвори- тельно)»/ «зачтено»	Выставляется обучающемуся, если он знает на базовом уровне теоретический и практический материал, допускает отдельные ошибки при его изложении на занятиях и в ходе промежуточной аттестации. Обучающийся испытывает определённые затруднения в применении теоретических положений при решении практических задач профессиональной направленности стандартного уровня сложности, владеет необходимыми для этого базовыми навыками и приёмами. Демонстрирует достаточный уровень знания учебной литературы по дисциплине. Оценка по дисциплине выставляется обучающемуся с учётом результатов текущей и промежуточной аттестации. Компетенции, закреплённые за дисциплиной, сформированы на уровне – «достаточный».
49-0/ F,FX	«неудовлетворите- льно»/ не зачтено	Выставляется обучающемуся, если он не знает на базовом уровне теоретический и практический материал, допускает грубые ошибки при его изложении на занятиях и в ходе промежуточной аттестации. Обучающийся испытывает серьёзные затруднения в применении теоретических положений при решении практических задач профессиональной направленности стандартного уровня сложности, не владеет необходимыми для этого навыками и приёмами. Демонстрирует фрагментарные знания учебной литературы по дисциплине. Оценка по дисциплине выставляется обучающемуся с учётом результатов текущей и промежуточной аттестации.

Баллы/ Шкала ECTS	Оценка по дисциплине	Критерии оценки результатов обучения по дисциплине
		Компетенции на уровне «достаточный», закреплённые за дисциплиной, не сформированы.

Критерии оценивания практических работ:

Критерии оценивания / Уровень требований к обучающемуся	Макс. кол- во баллов
Текущий контроль, всего в т.ч.:	60
Практическая работа	12
Задания выполнены не полностью и (или) допущены две и более ошибки или три и более недочета	1-6
Задания выполнены полностью, но допущены два-три недочета, в т. ч. при ответе на контрольные вопросы	7-9
Задания выполнены полностью, возможна одна неточность, ответы на контрольные вопросы правильные	10-12

- 5.3 Оценочные средства (материалы) для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

Примеры тестов

Наиболее распространенным вариантом стратегии управления финансовыми рисками предприятия выступает:

- а) высокорисковая стратегия;
- б) стратегия диверсификации рисков;
- в) стратегия минимизации рисков.

Наиболее опасной формой потерь от наступивших рисков выступают:

- а) дополнительные затраты;
- б) прямой ущерб;
- в) упущенная выгода.

Наиболее распространенным методом профилактики финансовых рисков предприятия выступает:

- а) диверсификация рисков по группам клиентов;
- б) диверсификация рисков по видам операций;
- в) эффективный маркетинг.

Наиболее распространенным методом компенсации потерь от наступивших финансовых рисков предприятия выступает:

- а) создание собственного финансового резерва;
- б) страхование финансовых рисков;
- в) использование заемных средств.

Из нижеперечисленных утверждений выберите верное:

- а) при прочих равных условиях снижение постоянных расходов ведет к снижению запаса финансовой прочности и росту операционного рычага;

- б) при прочих равных условиях увеличение постоянных расходов ведет к снижению запаса финансовой прочности и росту операционного рычага;
- в) при прочих равных условиях увеличение постоянных расходов ведёт к увеличению запаса финансовой прочности и операционного рычага;
- г) ни одно утверждение не верно.

Выберите из нижеперечисленных правильные утверждения:

- а) при приближении объема продаж к минимально допустимому (точке безубыточности) показатель операционного рычага растет;
- б) при последующем увеличении объема продаж показатель прибыли растет очень интенсивно, но запас финансовой прочности мал, т.е. положение фирмы не стабильно;
- в) при удалении от текущего объема продаж в сторону увеличения запас финансовой прочности высок, но показатель операционного рычага мал;
- г) верны все утверждения.

Выберите верное утверждение: В случае, когда часть постоянных затрат переходит в состав переменных (при неизменности их общей суммы):

- а) прибыль организации не меняется;
- б) точка безубыточности переходит на меньший уровень;
- в) запас финансовой прочности возрастает;
- г) операционный рычаг снижается;
- д) верны все утверждения.

Задания для практических работ представлены в разделе 9.

Вопросы по курсу.

1. Риск как статистическая категория.
2. Понятие риска в категориях принятия решений в условиях неопределенности.
3. Общие принципы классификации рисков.
4. Тенденции развития риск-менеджмента.
5. Сущность финансового риска в статистической задаче риск-менеджмента.
6. Статистическая оценка рисков.
7. Основные механизмы управления рисками.
8. Этапы статистического исследования риск-анализа.
9. Методы статистического анализа риска.
10. Система статистических показателей риска.
11. Критерии статистической оценки инвестиционных проектов и их роль в анализе проектных рисков.
12. Метод построения дерева решений.
13. Методы анализа рисков без учета распределения вероятностей.
14. Вероятностно-теоретические и выборочные методы.
15. Метод Монте-Карло.
16. Построение статистико-математической модели.
17. Статистический анализ неопределенности и чувствительности.
18. Проведение имитаций. Анализ результатов.
19. Измерение риска. Доходность и волатильность.
20. Концепция Value at Risk (VaR). Общий подход к оценке Value at Risk.
21. Финансовый инжиниринг как концепция управления риском

6 Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

6.1 Список литературы

Основная

1. Чертыковцев, В. К. Математическая теория рисков. Анализ рисков в социально-экономической сфере : учебник для вузов / В. К. Чертыковцев. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 102 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-14457-4. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://www.urait.ru/bcode/558358>.
2. Пузыня, Т. А. Основы риск-анализа : учебник и практикум для вузов / Т. А. Пузыня. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 69 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-21554-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://www.urait.ru/bcode/577331>.

Дополнительная

3. Миркин, Б. Г. Базовые методы анализа данных : учебник и практикум для вузов / Б. Г. Миркин. — 3-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 297 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-19709-9. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://www.urait.ru/bcode/560414>.
4. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 365 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-3502-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://www.urait.ru/bcode/560309>.
5. Основы риск-менеджмента / М. Круи, Д. Гэлаи, В. Б. Минасян, Р. Марк. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 388 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02578-1. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://www.urait.ru/bcode/559670>.
6. Анализ данных : учебник для вузов / под редакцией В. С. Мхитаряна. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 448 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-19964-2. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://www.urait.ru/bcode/560311>.
7. Криволапов, С. Я. Анализ данных. Методы теории вероятностей и математической статистики на языке Python : учебное пособие / С.Я. Криволапов. — Москва : ИНФРА-М, 2025. — 678 с. — (Высшее образование). — DOI 10.12737/2034420. - ISBN 978-5-16-018616-0. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.ru/catalog/product/2034420>.

6.2 Перечень ресурсов информационно-коммуникационной среды “Интернет»

1. Официальный сайт Министерства экономического развития РФ [Электронный ресурс] — URL: <http://www.economy.gov.ru> (дата обращения 15.05.2025)
2. eLIBRARY.RU[Электронный ресурс]: электронная библиотека / Науч. электрон. б-ка. — Москва. — URL: <http://elibrary.ru/> (дата обращения 15.05.2025).

6.3 Профессиональные базы данных и информационно-справочные системы Доступ к профессиональным базам данных: <https://liber.rsuh.ru/ru/bases>

Информационные справочные системы:

1. Консультант Плюс
2. Гарант

7 Материально-техническое обеспечение дисциплины

Для материально-технического обеспечения дисциплины необходимы:

- для лекций:

- учебная аудитория,
- доска,
- проектор (стационарный или переносной),
- компьютер или ноутбук,
- программное обеспечение (ПО).

- для практических занятий:

- лаборатория,
- доска,
- проектор (стационарный или переносной),
- компьютер или ноутбук для преподавателя,
- компьютеры для обучающихся,
- выход в Интернет,
- программное обеспечение (ПО).

Перечень программного обеспечения (ПО)

- для лекций:

№п/п	Наименование ПО	Способ распространения
1	Microsoft Office 2010 Pro	лицензионное
2	Windows 10	лицензионное
3	Kaspersky Endpoint Security	лицензионное

- для практических занятий:

Наименование ПО	Способ распространения
Windows 10	лицензионное
Microsoft Office 2010 Pro	лицензионное
Mozilla Firefox	свободно распространяемое
Kaspersky Endpoint Security	лицензионное
Microsoft SQL Server 2008	лицензионное
Microsoft Visual Professional 2019	лицензионное

8 Обеспечение образовательного процесса для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

В ходе реализации дисциплины используются следующие дополнительные методы обучения, текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся в зависимости от их индивидуальных особенностей:

- для слепых и слабовидящих:
 - лекции оформляются в виде электронного документа, доступного с помощью компьютера со специализированным программным обеспечением;
 - письменные задания выполняются на компьютере со специализированным программным обеспечением, или могут быть заменены устным ответом;
 - обеспечивается индивидуальное равномерное освещение не менее 300 люкс;
 - для выполнения задания при необходимости предоставляется увеличивающее устройство; возможно также использование собственных увеличивающих устройств;

- письменные задания оформляются увеличенным шрифтом;
- экзамен и зачёт проводятся в устной форме или выполняются в письменной форме на компьютере.

- для глухих и слабослышащих:
 - лекции оформляются в виде электронного документа, либо предоставляется звукоусиливающая аппаратура индивидуального пользования;
 - письменные задания выполняются на компьютере в письменной форме;
 - экзамен и зачёт проводятся в письменной форме на компьютере; возможно проведение в форме тестирования.
- для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:
 - лекции оформляются в виде электронного документа, доступного с помощью компьютера со специализированным программным обеспечением;
 - письменные задания выполняются на компьютере со специализированным программным обеспечением;
 - экзамен и зачёт проводятся в устной форме или выполняются в письменной форме на компьютере.

При необходимости предусматривается увеличение времени для подготовки ответа.

Процедура проведения промежуточной аттестации для обучающихся устанавливается с учётом их индивидуальных психофизических особенностей. Промежуточная аттестация может проводиться в несколько этапов.

При проведении процедуры оценивания результатов обучения предусматривается использование технических средств, необходимых в связи с индивидуальными особенностями обучающихся. Эти средства могут быть предоставлены университетом, или могут использоваться собственные технические средства.

Проведение процедуры оценивания результатов обучения допускается с использованием дистанционных образовательных технологий.

Обеспечивается доступ к информационным и библиографическим ресурсам в сети Интернет для каждого обучающегося в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

- для слепых и слабовидящих:
 - в печатной форме увеличенным шрифтом;
 - в форме электронного документа;
 - в форме аудиофайла.
- для глухих и слабослышащих:
 - в печатной форме;
 - в форме электронного документа.
- для обучающихся с нарушениями опорно-двигательного аппарата:
 - в печатной форме;
 - в форме электронного документа;
 - в форме аудиофайла.

Учебные аудитории для всех видов контактной и самостоятельной работы, научная библиотека и иные помещения для обучения оснащены специальным оборудованием и учебными местами с техническими средствами обучения:

- для слепых и слабовидящих:
 - устройством для сканирования и чтения с камерой SARA CE;
 - дисплеем Брайля PAC Mate 20;
 - принтером Брайля EmBraille ViewPlus;
- для глухих и слабослышащих:
 - автоматизированным рабочим местом для людей с нарушением слуха и слабослышащих;
 - акустический усилитель и колонки;
- для обучающихся с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

- передвижными, регулируемые эргономическими партами СИ-1;
- компьютерной техникой со специальным программным обеспечением.

9 Методические материалы

9.1 Планы практических занятий

Практическое занятие 1.

Тема 1. Сущность и предпосылки экономических рисков в рыночной экономике

Цель семинарского (практического) занятия – раскрыть сущность и предпосылки предпринимательских рисков, изучить объективные и субъективные причины предпринимательских рисков в рыночной экономике.

1. Сущность и предпосылки предпринимательских рисков в рыночной экономике.
2. Цель и задачи исследования предпринимательских рисков.
3. Этапы и причины возникновения исследования экономических рисков.

Тема 2. Виды и факторы экономических рисков

Цель семинарского (практического) занятия – усвоить классификации и факторы предпринимательских рисков

1. Классификация экономических рисков по типу и отраслевой направленности предпринимательства.
2. Классификация экономических рисков по стадиям осуществления бизнес-идеи.
3. Классификация экономических рисков по степени (уровню) риска.
4. Классификация экономических рисков в зависимости от уровня их действия.
5. Систематические и несистематические риски: понятие, отличительные особенности, виды.

Тема 3. Методы и приемы анализа и оценки экономических рисков

Цель семинарского (практического) занятия – усвоить методы и приемы оценки экономических рисков.

1. Статистические показатели абсолютной и относительной меры риска среднее ожидаемое значение результата,
2. Среднее линейное и среднее квадратическое отклонение результата, коэффициент вариации.
3. Факторный метод оценки экономического риска инвестиционных проектов.
4. Рейтинговые методы оценки степени риска.

Тема 4. Механизм управления риском, способы и средства снижения экономических рисков

Цель семинарского (практического) занятия – изучить механизм нейтрализации предпринимательских рисков.

1. Средства снижения предпринимательских рисков (избежание, передача, сохранения риска): сущность, способы реализации и взаимосвязь.
2. Информационное обеспечение как способ уменьшения предпринимательских рисков. Стоимость (ценность) информации.
3. Диверсификация как способ уменьшения риска: понятия, преимущества и границы применения.
4. Диверсификация производственной и коммерческой деятельности: возможности применения и оценка результативности.
5. Страхование и хеджирование как способ снижения риска. Критерии целесообразности страхования.

Тема 5. Анализ и оценка экономических рисков на предприятии

Цель семинарского (практического) занятия – проанализировать и дать оценку предпринимательского риска

Понятие предпринимательского риска, его учет в управлении финансами

2 Оценка риска на основе анализа финансового состояния предприятий

3 Модели оценки риска результатов планирования на основе расчета точки безубыточности

Тема 6. Исследование модели социальных рисков

Цель семинарского (практического) занятия – проанализировать и дать оценку социальных рисков

1. Понятие социального риска.

2. Модели социальных рисков.

2 Исследовать социально-экономическую систему при условиях:

- коэффициент устойчивости $k=0,001$, система ведет себя неустойчиво

- коэффициент устойчивости $k=0,0001$, система ведет себя квазиустойчиво

- коэффициент устойчивости $k=0,00001$, система ведет себя устойчиво

9.2 Методические рекомендации по подготовке письменных работ

Отчет по проделанной работе должен быть изложен с соблюдением правил грамматики русского и английского языков (в случаях необходимости). При этом отражаемые результаты работы должны быть информативными, тезисного порядка. В отчет входят следующие обязательные разделы:

1. Титульный лист с полным указанием ведомственной принадлежности, названия ВУЗа, института, факультета, кафедры. Кроме того, полное точное название лабораторной работы, Ф.И.О. студента, подготовившего отчет о результатах проделанной работы и Ф.И.О., должность, название кафедры преподавателя осуществляющего проверку и оценивание полученных результатов.
2. Содержание.
3. Введение.
4. Цели и задачи практической работы.
5. Методы и технологии, применяемые для решения поставленных задач оформленные в виде отдельных этапов работы.
6. Выводы по работе.
7. Приложения.

Оформление отчета выполняется с использованием компьютерной верстки LaTeX. Отчет сохраняется и представляет для проверки в виде отдельного pdf файла. В имени файла показывается фамилия студента и номер выполненной работы.

АННОТАЦИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель дисциплины – формирование знаний, умений, навыков в области проведения статистического анализа рисков при проведении статистических исследований социально-экономических явлений и процессов.

Задачи дисциплины:

1. Изучение методологии статистического исследования рисков.
2. Умение использовать основные принципы анализа статистических данных для решения задач исследования рисков.
3. Умение выявлять и ранжировать внешние и внутренние факторы, а также влияние заинтересованных сторон как источники рисковых событий.
4. Владение методиками анализа рисков и основными подходами в формировании аналитических материалов на основе проведенного анализа.

В результате освоения дисциплины обучающийся должен:

Знать:

- методологию статистического исследования рисков;
- виды зависимостей: функциональная, статистическая и корреляционная зависимости; основные положения регрессионного анализа;
- теоретические подходы к формированию инструментальной базы расчетов при подготовки аналитических материалов.

Уметь

- использовать основные принципы анализа статистических данных для решения задач исследования рисков;
- анализировать и содержательно интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики в области экономики, критически оценивать результаты и/или тенденции изменения социально-экономических показателей;
- выявлять и ранжировать внешние и внутренние факторы, а также влияние заинтересованных сторон как источники рисковых событий.

Владеть

- методиками анализа рисков и основными подходами в формировании аналитических материалов на основе проведенного анализа
- навыками статистического анализа и интерпретации информации, содержащейся в различных отечественных и зарубежных источниках;
- навыками применения практических методов качественной и количественной оценки рисков.

Рабочей программой предусмотрены следующие виды контроля: текущий контроль успеваемости в форме контрольной работы, промежуточная аттестация в форме зачета с оценкой.

Общая трудоемкость освоения дисциплины составляет 3 зачетные единицы.