

## Аннотация дисциплины Б.1.2.8 Дисциплина. Статистические методы оценки риска

Дисциплина "Статистические методы оценки риска" изучается обучающимися по основной профессиональной образовательной программе "Прикладная статистика и анализ данных" направления подготовки "01.03.05 Статистика".

Дисциплина изучается в 7 семестре. Общая трудоемкость дисциплины составляет 144/4 часов/з.ед. Самостоятельная работа заключается в выполнении работ, указанных в разделе 4.

В ходе изучения дисциплины осуществляется текущий контроль в форме технологии рейтингового контроля в соответствии с технологической карты дисциплины, размещенной на электронном курсе, а также промежуточный контроль в форме зачет.

Целью изучения дисциплины является формирование следующих компетенций:

1. ПК-1 Способен формировать систему взаимосвязанных статистических показателей, характеризующих экономические явления и процессы на макро-, мезо- и микроуровне
2. ПК-2 Способен осуществлять расчет и анализ показателей, характеризующих экономические явления и процессы на макро-, мезо- и микроуровне, на основе методов прикладной статистики

В ходе изучения дисциплины последовательно рассматриваются темы:

1. Тема 1. Предпринимательские риски организации  
Понятие риска. Ситуация риска. Основные черты риска: неопределенность, альтернативность, противоречивость.
2. Тема 2. Классификация предпринимательских рисков  
Классификация видов риска: по времени возникновения, по факторам возникновения, по характеру учета, по характеру последствий, по сфере возникновения. Финансовые риски и их классификация.
3. Тема 3. Оценка риска  
Показатели уровня риска. Области риска: безрисковая зона, минимального риска, повышенного риска, критического риска, недопустимого риска.  
Качественный и количественный анализ рисков.
4. Тема 4. Методы количественной оценки риска: статистический, метод анализа целесообразности затрат, экспертный, аналитический, метод анализа чувствительности модели, метод использования аналогов. Расчет показателей в рамках статистического метода оценки риска.
5. Тема 5. Управление предпринимательскими рисками организации  
Понятие управления риском (риск-менеджмента). Принципы соотношения риска и доходности. Основные принципы управления риском. Этапы процесса управления риском.
6. Тема 6. Методы управления рисками  
Методы управления риском: уклонения от рисков; локализации (диссипации) рисков; диверсификации (распределения) рисков; компенсации рисков. Классификация методов управления риском по различным критериям

Основными стратегическими образовательными технологиями являются: исследовательские, лекционные занятия, практические занятия, процедуры самообучения, дискуссионные, игровые процедуры.

В рамках указанных технологий применяются тактические образовательные технологии: задания, информационные, классическая лекция, мини-проекты, блиц-игра.