

# АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

## Б1.О.27 «Оценка рисков»

**Автор:** Д.э.н., доцент, профессор кафедры экономики и финансов Максимова И.В.

**Код и наименование направления подготовки, профиля:** 38.05.01 Экономическая безопасность, образовательная программа "Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности"

**Квалификация (степень) выпускника:** экономист

**Форма обучения:** очная, заочная

### Содержание дисциплины

#### **Тема 1. Научные основы оценки рисков предпринимательской деятельности**

Оценка рисков как наука и учебная дисциплина. Современные подходы к классификации рисков. Место и роль рисков в предпринимательской деятельности. Экономические, правовые и финансовые аспекты предпринимательских рисков. Риск как вероятность неблагоприятного исхода предпринимательской деятельности. Оценка степени предпринимательского риска в условиях неопределенности. Предпринимательские риски и экономическая свобода предпринимательства.

Области риска в предпринимательской деятельности. Возникновение рисков при постановке миссии и целей фирмы. Риски развития.

#### **Тема 2. Методология оценки риска банкротства предприятия**

Теоретические аспекты банкротства. Виды банкротства: фиктивное, преднамеренное, реальное, техническое. Причины банкротства: субъективные; объективные; внешние; внутренние. Основные факторы.

Основные подходы к предсказанию банкротства: количественный, качественный, метод интегральной бальной оценки достоинства и недостатки каждого из них.

Модель диагностики вероятности банкротства Э.Альтмана: содержание, достоинства и недостатки.

Модель диагностики вероятности банкротства У.Бивера: содержание, достоинства и недостатки.

Модель оценки вероятности банкротства организации по Р.Лису: содержание, достоинства и недостатки.

Модель диагностики вероятности банкротства Р.Таффлера: содержание, достоинства и недостатки.

Модель диагностики вероятности банкротства Г.Спрингейта: содержание, достоинства и недостатки.

Модель оценки платежеспособности Ж.Конана и М.Голдера: содержание, достоинства и недостатки.

Модель оценки вероятности банкротства организации по Дж.Фулмеру: содержание, достоинства и недостатки.

Модель прогнозирования банкротства предприятия Р.С.Сайфуллина и Г.Г.Кадыкова: содержание, достоинства и недостатки.

Модель прогнозирования банкротства предприятия А.Б.Перфильева.

Модель прогнозирования банкротства предприятия Г.В.Савицкой.

Модель оценки вероятности банкротства организации по Г.В.Давыдовой и А.Д.Беликову: содержание, достоинства и недостатки.

Модель оценки вероятности банкротства организации по А.С.Кучеренко: содержание, достоинства и недостатки.

Методика оценки вероятности банкротства организации по Л.В.Донцовой и Н.А.Никифоровой: содержание, достоинства и недостатки.

Модель оценки вероятности банкротства организации по В.В.Ковалеву: содержание, достоинства и недостатки.

Модель оценки вероятности банкротства организации по А.Н.Жилкиной: содержание, достоинства и недостатки.

### **Тема 3. Методология оценки риска снижения финансовой устойчивости предприятия**

Показатели финансовой устойчивости: коэффициент концентрации собственного капитала; коэффициент финансовой зависимости; коэффициент маневренности собственного капитала; коэффициент концентрации заемного капитала; коэффициент структуры долгосрочных вложений; коэффициент долгосрочного привлечения заемных средств; коэффициент структуры заемного капитала; коэффициент задолженности; коэффициент соотношения заемного и собственного капитала; коэффициент финансовой устойчивости организации.

### **Тема 4. Методология оценки риска снижения деловой активности предприятия**

Факторы, оказывающие влияние на деловую активность организации: мезоуровень – отраслевая принадлежность; сфера деятельности; масштаб деятельности; влияние информационных ресурсов; характер хозяйственных связей с партнерами; отраслевая принадлежность; микроуровень – Эффективность стратегии управления активами; ценовая политика; методика оценки товарно-материальных ценностей и запасов.

Влияние изменений в среде поставщиков на финансовую деятельность предприятий.

Макросреда предпринимательства и факторы на нее влияющие.

Структура оценки деловой активности: качественные и количественные критерии.

Показатели деловой активности: коэффициент оборачиваемости всех активов; коэффициент оборачиваемости оборотных активов; коэффициент оборачиваемости материальных средств; коэффициент оборачиваемости денежных средств; коэффициент оборачиваемости дебиторской задолженности; оборачиваемость в днях дебиторской задолженности; коэффициент оборачиваемости кредиторской задолженности; оборачиваемость в днях кредиторской задолженности; коэффициент оборачиваемости собственного капитала.

### **Тема 5. Методология оценки риска снижения эффективности производственной деятельности предприятия**

Оценка технического риска на предприятии.

Оценка транспортного риска на предприятии.

Оценка риска снижения эффективности хранения готовой продукции.

Оценка риска снабжения предприятия.

Оценка риска снижения эффективности управленческой деятельности предприятия.

Оценка риска снижения эффективности сбытовой деятельности предприятия.

### **Тема 6. Методология оценки риска снижения эффективности кадрового обеспечения предприятия**

Оценка риска снижения эффективности структуры управления организации.

Оценка риска снижения эффективности системы мотивации персонала организации.

Оценка риска снижения эффективности системы трудовой адаптации сотрудников организации.

Оценка риска снижения эффективности маркетинга персонала организации.

Оценка риска снижения производительности труда персонала организации.

Оценка риска снижения эффективности системы повышения квалификации персонала организации.

### **Тема 7. Методология оценки риска снижения эффективности маркетинговой деятельности предприятия**

Оценка риска снижения эффективности структуры управления маркетинговой деятельности предприятия.

Оценка риска снижения эффективности структуры управления ассортиментом.

Оценка риска снижения эффективности ценовой политики организации.

Оценка риска снижения эффективности коммуникационной политики организации.

Оценка риска снижения эффективности рекламной деятельности.

### **Основная литература**

1. Воронцовский, А. В. Оценка рисков : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 179 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02411-1. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait-ru.ezproxy.ranepa.ru:2443/bcode/471513> (дата обращения: 29.06.2021).

2. Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе : учебник и практикум для вузов / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 381 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00375-8. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait-ru.ezproxy.ranepa.ru:2443/bcode/468977> (дата обращения: 29.06.2021).