

Министерство науки и высшего образования РФ
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«СИБИРСКИЙ ФЕДЕРАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

СОГЛАСОВАНО

Заведующий кафедрой

**Кафедра экономики и
управления бизнес-процессами**

наименование кафедры

подпись, инициалы, фамилия

«___» _____ 20__ г.

институт, реализующий ОП ВО

УТВЕРЖДАЮ

Заведующий кафедрой

**Кафедра экономики и управления
бизнес-процессами**

наименование кафедры

И.Р. Руйга

подпись, инициалы, фамилия

«___» _____ 20__ г.

институт, реализующий дисциплину

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
ФИНАНСОВАЯ АНАЛИТИКА И
МЕТОДЫ ПРОТИВОДЕЙСТВИЯ
ФИНАНСОВО-ЭКОНОМИЧЕСКИМ
НАРУШЕНИЯМ
ОЦЕНКА РИСКОВ**

Дисциплина **Б1.Б.23.01 ФИНАНСОВАЯ АНАЛИТИКА И МЕТОДЫ
ПРОТИВОДЕЙСТВИЯ ФИНАНСОВО-
ЭКОНОМИЧЕСКИМ НАРУШЕНИЯМ**
Оценка рисков

Направление подготовки / **38.05.01 Экономическая безопасность**
специальность **Специализация 38.05.01.01 Экономико-
правовое обеспечение экономической**

Направленность
(профиль)

Форма обучения **очная**

Год набора **2021**

Красноярск 2021

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

составлена в соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по укрупненной группе

380000 «ЭКОНОМИКА И УПРАВЛЕНИЕ»

Направление подготовки /специальность (профиль/специализация)

Специальность 38.05.01 Экономическая безопасность Специализация

38.05.01.01 Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Программу
составили

к.э.н., Доцент, Бурменко Русудана Рашидовна

1 Цели и задачи изучения дисциплины

1.1 Цель преподавания дисциплины

Цель преподавания дисциплины «Оценка рисков» заключается в изучении теоретических и прикладных основ теории риска и финансового риск-менеджмента в условиях рыночной экономики Российской Федерации, а также в формировании у студентов современного экономического мышления, позволяющего обосновывать и организовывать реализацию управленческих финансовых решений в условиях неопределённости и риска.

1.2 Задачи изучения дисциплины

Курс «Оценка рисков» ориентирован на формирование у студентов системы знаний и устойчивых представлений о сущности, структуре, функциях и механизмах анализа финансовых рисков, умений и практических навыков, необходимых для деятельности в области финансового риск-менеджмента; а также на развитие способностей и готовности эффективно использовать знания и навыки для решения задач эффективного управления рисками.

1.3 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

ОПК-1: способностью применять математический инструментарий для решения экономических задач	
Уровень 1	основные методы вычислений параметров риска с использованием функций финансовой математики
Уровень 2	математические модели оценки финансовых рисков
Уровень 1	применять на практике методы, техники, технологии, программные средства и информационные базы идентификации и анализа изменения различных видов риска
Уровень 2	осуществлять выбор инструментальных средств для обработки экономических данных для определения уровня рисков
Уровень 1	методиками расчета уровня рисков предприятия
Уровень 2	методиками оценки эффективности инвестиций, направленных на снижение уровня рисков
ПК-31: способностью на основе статистических данных исследовать социально-экономические процессы в целях прогнозирования возможных угроз экономической безопасности	
Уровень 1	теорию риска, классификацию рисков, в том числе финансовых
Уровень 2	методы риск-менеджмента для эффективного управления рисками
Уровень 1	проводить сбор и анализ исходных данных, необходимых для расчета экономических и социально-экономических показателей,

	характеризующих уровень рисков хозяйствующих субъектов
Уровень 2	на основе типовых методик рассчитать уровень рисков хозяйствующих субъектов
Уровень 3	осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения поставленных задач по эффективному управлению рисками
Уровень 1	методами качественной и количественной оценки рисков
Уровень 2	методами управления рисками на основе организации риск-менеджмента на предприятии
ПК-32: способностью проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности	
Уровень 1	методики анализа результатов расчета и обоснования полученных выводов критически оценивать предлагаемые варианты управленческих решений
Уровень 1	осуществлять выбор инструментальных средств для обработки экономических данных, разрабатывать и обосновывать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности
Уровень 2	разрабатывать и обосновывать предложения по снижению рисков и возможных социально-экономических последствий
Уровень 1	методами риск-менеджмента в процессе производственной деятельности предприятий
Уровень 2	методиками оценки эффективности финансовых инвестиций
ПК-40: способностью осуществлять экспертную оценку факторов риска, способных создавать социально-экономические ситуации критического характера, оценивать возможные экономические потери в случае нарушения экономической и финансовой безопасности, определять необходимые компенсационные резервы	
Уровень 1	взаимосвязь уровня технико-экономических показателей деятельности предприятия и величины рисков, на основе данных бухгалтерской, налоговой, бюджетной и статистической отчетности
Уровень 2	методики анализа результатов расчета и обоснования полученных выводов, критически оценивать предлагаемые варианты управления рисками
Уровень 1	осуществлять выбор инструментальных средств для обработки экономических данных, разрабатывать и обосновывать предложения по их совершенствованию с учетом критериев минимизации рисков
Уровень 2	разрабатывать и обосновывать предложения по снижению рисков и возможных социально-экономических последствий
Уровень 1	методами риск-менеджмента в процессе производственной деятельности предприятий
Уровень 2	методиками оценки эффективности инвестиций, направленных на снижение уровня рисков; определять необходимые компенсационные резервы

1.4 Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Изучение дисциплины "Оценка рисков" призвано расширить и углубить знания, полученные при освоении соответствующих дисциплин:

- Экономика предприятия
- Экономико-математические методы
- Эконометрика

- Эконометрика
- Основы математического программирования
- Экономика предприятия

Данная дисциплина является основой для изучения программы учебных дисциплин:

- Экономический анализ
- Моделирование экономических процессов
- Инвестиционный анализ
- Экономическая безопасность

- Экономический анализ
- Деньги, кредит, банки
- Экономическая безопасность
- Моделирование экономических процессов

1.5 Особенности реализации дисциплины

Язык реализации дисциплины Русский.

Дисциплина (модуль) реализуется без применения ЭО и ДОТ.

2. Объем дисциплины (модуля)

Вид учебной работы	Всего, зачетных единиц (акад.час)	Семестр
		5
Общая трудоемкость дисциплины	5 (180)	5 (180)
Контактная работа с преподавателем:	2 (72)	2 (72)
занятия лекционного типа	1 (36)	1 (36)
занятия семинарского типа		
в том числе: семинары		
практические занятия	1 (36)	1 (36)
практикумы		
лабораторные работы		
другие виды контактной работы		
в том числе: групповые консультации		
индивидуальные консультации		
иная внеаудиторная контактная работа:		
групповые занятия		
индивидуальные занятия		
Самостоятельная работа обучающихся:	2 (72)	2 (72)
изучение теоретического курса (ТО)		
расчетно-графические задания, задачи (РГЗ)		
реферат, эссе (Р)		
курсовое проектирование (КП)	Нет	Нет
курсовая работа (КР)	Нет	Нет
Промежуточная аттестация (Экзамен)	1 (36)	1 (36)

3 Содержание дисциплины (модуля)

3.1 Разделы дисциплины и виды занятий (тематический план занятий)

№ п/п	Модули, темы (разделы) дисциплины	Занятия лекционного типа (акад. час)	Занятия семинарского типа		Самостоятельная работа, (акад. час)	Формируемые компетенции
			Семинары и/или Практические занятия (акад. час)	Лабораторные работы и/или Практикумы (акад. час)		
1	2	3	4	5	6	7
1	Теоретические основы понятия риска	4	4	0	13	ОПК-1 ПК-31 ПК-32 ПК-40
2	Методы оценки рисков	10	10	0	20	ОПК-1 ПК-31 ПК-32 ПК-40
3	Финансовые риски	8	8	0	15	ОПК-1 ПК-31 ПК-32 ПК-40
4	Инвестиционные риски	8	8	0	15	ОПК-1 ПК-31 ПК-32 ПК-40
5	Организация риск менеджмента	6	6	0	9	ОПК-1 ПК-31 ПК-32 ПК-40
Всего		36	36	0	72	

3.2 Занятия лекционного типа

№ п/п	№ раздела дисциплины	Наименование занятий	Объем в акад. часах		
			Всего	в том числе, в инновационной форме	в том числе, в электронной форме
1	1	Тема 1.1. Теория риска, развитие основных положений теории и оценки рисков	2	0	0
2	1	Тема 1.2. Понятия «риск» и «неопределенность». Виды и классификация рисков	2	0	0

3	2	Тема 2.1. Качественные методы оценки риска	4	0	0
4	2	Тема 2.2. Количественные методы оценки риска	6	0	0
5	3	Тема 3.1. Финансовые инструменты инвестирования	2	0	0
6	3	Тема 3.2. Методы анализа и оценки финансовых рисков	6	0	0
7	4	Тема 4.1. Характеристика инвестиционных рисков	4	0	0
8	4	Тема 4.2. Оценка эффективности инвестиционных проектов	4	0	0
9	5	Тема 5.1. Управление рисками предприятия	4	0	0
10	5	Тема 5.2. Организация риск - менеджмента	2	0	0
Всего			26	0	0

3.3 Занятия семинарского типа

№ п/п	№ раздела дисциплины	Наименование занятий	Объем в акад. часах		
			Всего	в том числе, в инновационной форме	в том числе, в электронной форме
1	1	Тема 1.1. Теория риска, развитие основных положений теории и оценки рисков	2	0	0
2	1	Тема 1.2. Понятия «риск» и «неопределенность». Виды и классификация рисков	2	0	0
3	2	Тема 2.1. Качественные методы оценки риска	4	0	0
4	2	Тема 2.2. Количественные методы оценки риска	6	0	0
5	3	Тема 3.1. Финансовые инструменты инвестирования	2	0	0

6	3	Тема 3.2. Методы анализа и оценки финансовых рисков	6	0	0
7	4	Тема 4.1. Характеристика инвестиционных рисков	4	0	0
8	4	Тема 4.2. Оценка эффективности инвестиционных проектов	4	0	0
9	5	Тема 5.1. Управление рисками предприятия	2	0	0
10	5	Тема 5.2. Организация риск - менеджмента	2	0	0
11	5	Тема 5.3. Организация риск менеджмента на промышленных предприятиях в отечественной практике	2	0	0
Итого			26	0	0

3.4 Лабораторные занятия

№ п/п	№ раздела дисциплины	Наименование занятий	Объем в акад. часах		
			Всего	в том числе, в инновационной форме	в том числе, в электронной форме
Итого					

5 Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации

Оценочные средства находятся в приложении к рабочим программам дисциплин.

6 Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

6.1. Основная литература			
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л1.1	Алымов В. Т., Крапчатов В.П., Тарасова Н.П.	Анализ техногенного риска: учеб. пос. для вузов	Москва: Круглый год, 2000
Л1.2	Буянов В.П., Кирсанов К.А., Михайлов Л.А.	Управление рисками (рискология)	Москва: Экзамен, 2002
Л1.3	Анискин Ю.П.	Управление инвестициями: учеб. пособие	Москва: Омега-Л, 2002

Л1.4	Зуб А.Т., Панина Е. М.	Антикризисное управление организацией: Учебное пособие	Москва: Издательский Дом "ФОРУМ", 2020
6.2. Дополнительная литература			
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Волков И.М., Грачева М.В.	Проектный анализ: продвинутый курс: учебное пособие для студентов вузов по направлению 52600 Экономика и специальности 060100 Экономическая теория	Москва: МГУ им. М. В. Ломоносова, 2004
Л2.2	Орехов В. И., Балдин К. В., Орехова Т. Р.	Антикризисное управление: Учебное пособие	Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2019

8 Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

Освоение дисциплины предполагает контактную и самостоятельную работу. Первая состоит из лекционных и практических занятий в соответствии с учебным планом и графиком организации учебного процесса.

Лекционные занятия включают вводную лекцию, на которой до сведения обучающего доводятся основные сведения о дисциплине, обосновывается ее роль в соответствующей области знаний, определяется значение дисциплины для формирования профессиональных компетенций; модульные лекции, предназначенные для овладения обучающимися знаниями в рамках материала модуля ОП ВО; тьюторинг в виде лекционных занятий консультативного типа, на которых раскрываются основные вопросы, связанные с подготовкой к самостоятельной работе, текущей и итоговой аттестации.

Практические занятия включают в себя проведение подготовительных работ в форме обсуждения изучаемой тематики, а также выполнение типовых заданий с применением профессиональных методов и технологий, направленных на решение конкретных задач.

На лекционных и практических занятиях применяются следующие формы работы:

- лекции-визуализации с соблюдением визуальной логики и ритма подачи информации;
- использование методов проблемного изложения при рассмотрении практических аспектов материала дисциплины;
- дискуссионные обсуждения выделенных проблем;

– анализ правовой и регламентирующей базы изучаемых вопросов;

– анализ прикладных ситуаций.

Самостоятельная работа студентов в соответствии с учебным планом проводится с целью углубления знаний по дисциплине и предусматривает самостоятельное изучение теоретического материала, подготовку к тематическому тестированию и контрольным работам.

Изучение теоретического курса заключается в самостоятельном прорабатывании материала. Материал, законспектированный на лекциях, необходимо регулярно дополнять сведениями из литературных источников. По каждой теме для самостоятельного изучения следует сначала прочитать рекомендованную литературу и при необходимости составить краткий конспект основных положений, терминов, сведений, требующих запоминания и являющихся основополагающими в этой теме и для освоения последующих разделов курса.

В качестве отработки пропущенных занятий студенты обязаны самостоятельно изучить тему, законспектировать и устно отчитаться на консультации у преподавателя.

При оформлении отчетов и подготовке к защите практических работ используются: конспект лекций, рекомендуемая литература, а также специальные информационные ресурсы. Этот вид самостоятельной работы способствует умению излагать изученный материал в форме отчетов, представлять и докладывать результаты работы; умению проводить расчеты и делать выводы.

Для расширения знаний по дисциплине рекомендуется использовать Интернет-ресурсы, специализированные электронные ресурсы, проводить поиск в системах, рекомендованных в кратком библиографическом справочнике.

Форма промежуточной аттестации:

- экзамен.

Для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья форма проведения занятий, учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся разрабатываются с учетом особенностей их психофизического развития, индивидуальных возможностей, состояния здоровья на основе рекомендаций, данными МСЭ (медико-социальная экспертиза) или ПМПК (психолого-медико-педагогическая комиссия).

9 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю) (при необходимости)

9.1 Перечень необходимого программного обеспечения

9.1.1	Для освоения данной дисциплины необходимо программное обеспечение MS Office (MS Word, MS PowerPoint, MS Excel).
-------	---

9.2 Перечень необходимых информационных справочных систем

9.2.1	Каждый студент в течение всего периода обучения по дисциплине обеспечивается индивидуальным неограниченным доступом к электронно-библиотечным системам (электронным библиотекам), к электронной информационно-образовательной среде Университета а также к системе электронного обучения e.sfu-kras.ru при ее использовании преподавателем.
9.2.2	Электронная библиотечная система (электронная библиотека) и электронная информационно-образовательная среда обеспечивают возможность доступа обучающегося из любой точки, в которой имеется доступ к сети Интернет, и отвечают техническим требованиям организации, как на территории Университета, так и вне ее.
9.2.3	Для освоения ряда разделов дисциплины необходим доступ к актуальным версиям следующих информационно-справочных систем:
9.2.4	- «Консультант Плюс»;
9.2.5	- «ГАРАНТ».

10 Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)

Методика проведения занятий допускает как использование технических средств (проекторы, интерактивные доски), так и проведение занятий в классических аудиториях, обеспечиваемых стандартными материально-техническими средствами.

При использовании технических средств для проведения лекционных занятий необходим мультимедийный комплекс для учебных аудиторий, включающий интерактивную проекционную систему, компьютер для преподавателя с выходом в Интернет, интерактивный сенсорный дисплей, систему звукового сопровождения отображаемых материалов или доска для письма с маркерами.

Аудитория для проведения практических занятий должна быть оснащена компьютерами с выходом в Интернет или в аудитории должна быть возможность выхода в Интернет (при использовании личного ПК), доской для письма маркерами.

Для выполнения самостоятельной работы каждый студент должен иметь доступ к электронной информационно-образовательной среде организации с удаленного рабочего места (личный ПК, планшет, ПК в читальном зале библиотеки).