

Министерство науки и высшего образования РФ  
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение  
высшего образования  
«СИБИРСКИЙ ФЕДЕРАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»  
**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

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

наименование дисциплины (модуля) в соответствии с учебным планом

Направление подготовки / специальность

38.05.01 ЭКОНОМИЧЕСКАЯ БЕЗОПАСНОСТЬ

Направленность (профиль)

38.05.01.01 Экономико-правовое обеспечение экономической  
безопасности

Форма обучения

очная

Год набора

2019

## **РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

Программу составили \_\_\_\_\_

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

\_\_\_\_\_  
должность, инициалы, фамилия

## 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

Код и наименование индикатора достижения компетенции	Запланированные результаты обучения по дисциплине
<b>ОПК-1: способностью применять математический инструментарий для решения экономических задач</b>	
ОПК-1: способностью применять математический инструментарий для решения экономических задач	основные методы вычислений параметров риска с использованием функций финансовой математики математические модели оценки финансовых рисков применять на практике методы, техники, технологии, программные средства и информационные базы идентификации и анализа изменения различных видов риска осуществлять выбор инструментальных средств для обработки экономических данных для определения уровня рисков методиками расчета уровня рисков предприятия методиками оценки эффективности инвестиций, направленных на снижение уровня рисков
<b>ПК-31: способностью на основе статистических данных исследовать социально-экономические процессы в целях прогнозирования возможных угроз экономической безопасности</b>	

<p>ПК-31: способностью на основе статистических данных исследовать социально-экономические процессы в целях прогнозирования возможных угроз экономической</p>	<p>теорию риска, классификацию рисков, в том числе финансовых методы риск-менеджмента для эффективного управления рисками проводить сбор и анализ исходных данных, необходимых для расчета экономических и социально-экономических показателей,</p>
<p>безопасности</p>	<p>характеризующих уровень рисков хозяйствующих субъектов на основе типовых методик рассчитать уровень рисков хозяйствующих субъектов осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения поставленных задач по эффективному управлению рисками методами качественной и количественной оценки рисков методами управления рисками на основе организации риск-менеджмента на предприятии</p>
<p><b>ПК-32: способностью проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности</b></p>	
<p>ПК-32: способностью проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности</p>	<p>методики анализа результатов расчета и обоснования полученных выводов критически оценивать предлагаемые варианты управленческих решений осуществлять выбор инструментальных средств для обработки экономических данных, разрабатывать и обосновывать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности разрабатывать и обосновывать предложения по снижению рисков и возможных социально-экономических последствий методами риск -менеджмента в процессе производственной деятельности предприятий методиками оценки эффективности финансовых инвестиций</p>
<p><b>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</b></p>	

ПК-40: способностью осуществлять экспертную оценку факторов риска, способных создавать социально-экономические ситуации критического характера, оценивать возможные экономические	взаимосвязь уровня технико-экономических показателей деятельности предприятия и величины рисков, на основе данных бухгалтерской, налоговой, бюджетной и статистической отчетности методики анализа результатов расчета и обоснования полученных выводов, критически оценивать предлагаемые варианты управления рисками осуществлять выбор инструментальных средств для
потери в случае нарушения экономической и финансовой безопасности, определять необходимые компенсационные резервы	обработки экономических данных, разрабатывать и обосновывать предложения по их совершенствованию с учетом критериев минимизации рисков разрабатывать и обосновывать предложения по снижению рисков и возможных социально-экономических последствий методами риск-менеджмента в процессе производственной деятельности предприятий методиками оценки эффективности инвестиций, направленных на снижение уровня рисков; определять необходимые компенсационные резервы

#### **1.4 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)	е
		1
<b>Контактная работа с преподавателем:</b>	<b>2 (72)</b>	
занятия лекционного типа	1 (36)	
практические занятия	1 (36)	
<b>Самостоятельная работа обучающихся:</b>	<b>2 (72)</b>	
курсовое проектирование (КП)	Нет	
курсовая работа (КР)	Нет	
<b>Промежуточная аттестация (Экзамен)</b>	<b>1 (36)</b>	

### 3 Содержание дисциплины (модуля)

#### 3.1 Разделы дисциплины и виды занятий (тематический план занятий)

		Контактная работа, ак. час.							
№ п/п	Модули, темы (разделы) дисциплины	Занятия лекционного типа		Занятия семинарского типа				Самостоятельная работа, ак. час.	
				Семинары и/или Практические занятия		Лабораторные работы и/или Практикумы			
		Всего	В том числе в ЭИОС	Всего	В том числе в ЭИОС	Всего	В том числе в ЭИОС	Всего	В том числе в ЭИОС
<b>1. Теоретические основы понятия риска</b>									
	1. Тема 1.1. Теория риска, развитие основных положений теории и оценки рисков	2							
	2. Тема 1.2. Понятия «риск» и «неопределенность». Виды и классификация рисков	2							
	3. Тема 1.1. Теория риска, развитие основных положений теории и оценки рисков			2					
	4. Тема 1.2. Понятия «риск» и «неопределенность». Виды и классификация рисков			2					
	5. Тема 1.1. Теория риска, развитие основных положений теории и оценки рисков							5	
	6. Тема 1.2. Понятия «риск» и «неопределенность». Виды и классификация рисков							8	
<b>2. Методы оценки рисков</b>									
	1. Тема 2.1. Качественные методы оценки риска	4							

2. Тема 2.2. Количественные методы оценки риска	6							
3. Тема 2.1. Качественные методы оценки риска			4					
4. Тема 2.2. Количественные методы оценки риска			6					
5. Тема 2.1. Качественные методы оценки риска							10	
6. Тема 2.2. Количественные методы оценки риска							10	
<b>3. Финансовые риски</b>								
1. Тема 3.1. Финансовые инструменты инвестирования	2							
2. Тема 3.2. Методы анализа и оценки финансовых рисков	6							
3. Тема 3.1. Финансовые инструменты инвестирования			2					
4. Тема 3.2. Методы анализа и оценки финансовых рисков			6					
5. Тема 3.1. Финансовые инструменты инвестирования							6	
6. Тема 3.2. Методы анализа и оценки финансовых рисков							9	
<b>4. Инвестиционные риски</b>								
1. Тема 4.1. Характеристика инвестиционных рисков	4							
2. Тема 4.2. Оценка эффективности инвестиционных проектов	4							
3. Тема 4.1. Характеристика инвестиционных рисков			4					
4. Тема 4.2. Оценка эффективности инвестиционных проектов			4					
5. Тема 4.1. Характеристика инвестиционных рисков							6	
6. Тема 4.2. Оценка эффективности инвестиционных проектов							9	
<b>5. Организация риск - менеджмента</b>								
1. Тема 5.1. Управление рисками предприятия	4							



2. Тема 5.2. Организация риск - менеджмента	2							
3. Тема 5.1. Управление рисками предприятия			2					
4. Тема 5.2. Организация риск - менеджмента			2					
5. Тема 5.3. Организация риск менеджмента на промышленных предприятиях в отечественной практике			2					
6. Тема 5.1. Управление рисками предприятия							9	
Всего	36		36				72	

## **4 Учебно-методическое обеспечение дисциплины**

### **4.1 Печатные и электронные издания:**

1. Алымов В. Т., Крапчатов В.П., Тарасова Н.П. Анализ техногенного риска: учеб. пос. для вузов(Москва: Круглый год).
2. Буянов В.П., Кирсанов К.А., Михайлов Л.А. Управление рисками (рискология)(Москва: Экзамен).
3. Анискин Ю.П. Управление инвестициями: учеб. пособие(Москва: Омега-Л).
4. Зуб А.Т., Панина Е. М. Антикризисное управление организацией: Учебное пособие(Москва: Издательский Дом "ФОРУМ").
5. 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).
6. Орехов В. И., Балдин К. В., Орехова Т. Р. Антикризисное управление: Учебное пособие(Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М").

### **4.2 Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в том числе отечественного производства (программное обеспечение, на которое университет имеет лицензию, а также свободно распространяемое программное обеспечение):**

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

### **4.3 Интернет-ресурсы, включая профессиональные базы данных и информационные справочные системы:**

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.
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.
3. Для освоения ряда разделов дисциплины необходим доступ к актуальным версиям следующих информационно-справочных систем:
4. - «Консультант Плюс»;
5. - «ГАРАНТ».

## **5 Фонд оценочных средств**

Оценочные средства находятся в приложении к рабочим программам дисциплин.

## **6 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).