

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

Б1.О.30.01 МОДУЛЬ: КОРПОРАТИВНЫЕ ФИНАНСОВО
-ЭКОНОМИЧЕСКИЕ БИЗНЕС-ПРОЦЕССЫ

Оценка рисков

наименование дисциплины (модуля) в соответствии с учебным планом

Направление подготовки / специальность

38.05.01 Экономическая безопасность

Направленность (профиль)

38.05.01.31 Экономическая безопасность и финансовый мониторинг
национальных, региональных и корпоративных социально-
экономических систем

Форма обучения

очная

Год набора

2022

Красноярск 2023

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
ОПК-2: Способен осуществлять сбор, анализ и использование данных хозяйственного, налогового и бюджетного учетов, учетной документации, бухгалтерской (финансовой), налоговой и статистической отчетности в целях оценки эффективности и прогнозирования финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующего субъекта, а также выявления, предупреждения, локализации и нейтрализации внутренних и внешних угроз и рисков.	
ОПК-2.3: Использует количественные и качественные методы оценки эффективности и прогнозирования финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующего субъекта, а также выявления, предупреждения, локализации и нейтрализации внутренних и внешних угроз и рисков.	теорию риска, классификацию рисков, в том числе финансовых рисков методы риск-менеджмента и математические модели оценки финансовых рисков проводить сбор и анализ исходных данных, необходимых для расчета качественных и количественных показателей риска методами качественной и количественной оценки рисков методами управления рисками
ПК-1: Способен на основе обоснованного выбора методик и действующей нормативно-правовой базы проводить количественную и качественную оценку рисков для принятия управленческих решений, построения организационно-управленческих моделей и интегрированных систем управления рисками в организациях, в том числе по линии ПОД/ФТ	

ПК-1.2: Применяет на практике методы, техники, технологии, программные	взаимосвязь уровня технико-экономических показателей деятельности предприятия и величины рисков, на основе данных бухгалтерской, налоговой,
средства и информационные базы идентификации и анализа изменения различных видов риска в динамике на основе использования бухгалтерской, налоговой, бюджетной и статистической отчетности	бюджетной и статистической отчетности методики анализа изменения различных видов риска в динамике на основе использования бухгалтерской, налоговой, бюджетной и статистической отчетности осуществлять выбор техники, технологии, программных средств для 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 выбранными методами обработки экономических данных, разрабатывать и обосновывать предложения по их совершенствованию с учетом критериев минимизации рисков методами идентификации и анализа изменения различных видов риска в динамике на основе использования бухгалтерской, налоговой, бюджетной и статистической отчетности
ПК-1.3: Представляет результаты расчетно-экономических процедур в процессе планово-отчетной работы в соответствии с принятыми стандартами для последующего построения организационно-управленческих моделей и интегрированных систем управления рисками в организациях	организационно-управленческие модели и интегрированные системы управления рисками в организациях методики расчетно-экономических процедур в процессе планово-отчетной работы для последующего построения организационно-управленческих моделей и интегрированных систем управления рисками в организациях осуществлять выбор инструментальных средств для обработки экономических данных, разрабатывать и обосновывать предложения по их совершенствованию с учетом критериев минимизации рисков разрабатывать и обосновывать предложения по снижению рисков на основе полученных результатов расчетно-экономических процедур в процессе планово-отчетной работы организации методами риск-менеджмента в процессе производственной деятельности предприятий методиками оценки эффективности инвестиций, направленных на снижение уровня рисков методами управления рисками на основе организации риск-менеджмента на предприятии

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)	с
		1
Контактная работа с преподавателем:	2 (72)	
занятия лекционного типа	1 (36)	
практические занятия	1 (36)	
Самостоятельная работа обучающихся:	2 (72)	
курсовое проектирование (КП)	Нет	
курсовая работа (КР)	Нет	
Промежуточная аттестация (Экзамен)	1 (36)	

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
1. Теоретические основы понятия риска									
	1. Тема 1.1. Теория риска, развитие основных положений теории и оценки рисков	2							
	2. Тема 1.1. Теория риска, развитие основных положений теории и оценки рисков			2					
	3. Тема 1.2. Понятия «риск» и «неопределенность». Виды и классификация 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	
2. Методы оценки рисков									
	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	
3. Финансовые риски								
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	
4. Инвестиционные риски								
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	
5. Организация риск - менеджмента								
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).