

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

**СОГЛАСОВАНО**

**Заведующий кафедрой**

**Кафедра финансов и управления  
рисками**

наименование кафедры

подпись, инициалы, фамилия

«\_\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

институт, реализующий ОП ВО

**УТВЕРЖДАЮ**

**Заведующий кафедрой**

**Кафедра финансов и управления  
рисками**

наименование кафедры

**И.С. Ферова**

подпись, инициалы, фамилия

«\_\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

институт, реализующий дисциплину

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ  
ОЦЕНКА РИСКОВ**

Дисциплина Б1.Б.26 Оценка рисков

Направление подготовки / 38.05.01 Экономическая безопасность  
специальность Специализация 38.05.01.06 Финансово-  
экономическое обеспечение федеральных

Направленность  
(профиль)

Форма обучения

очная

Год набора

2017

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

---

38.05.01.06 Финансово-экономическое обеспечение федеральных государственных органов, обеспечивающих безопасность Российской Федерации

---

Программу  
составили

канд.эконом.наук, Доцент, Прокопович Дмитрий  
Алексеевич

---

## 1 Цели и задачи изучения дисциплины

### 1.1 Цель преподавания дисциплины

формирование риск-ориентированного стиля управленческого мышления

### 1.2 Задачи изучения дисциплины

Формирование системных представлений о сущности риска и его видах.

Освоение методических подходов к оценке рисков.

Изучение возможностей имитационного моделирования для оценки риска.

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

<b>ОПК-1: способностью применять математический инструментарий для решения экономических задач</b>	
Уровень 2	математические методы, применяемые при оценке рисков
Уровень 2	составлять математические модели оценки рисков
<b>ПК-31: способностью на основе статистических данных исследовать социально-экономические процессы в целях прогнозирования возможных угроз экономической безопасности</b>	
Уровень 2	методы обработки статистических данных
Уровень 2	осуществлять предварительную обработку данных, строить модель оценки рисков и находить её параметры
<b>ПК-32: способностью проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности</b>	
Уровень 2	современные классификации экономических рисков
Уровень 2	на основе анализа качественных и количественных данных высказывать аргументированные суждения об уязвимостях экономического субъекта и предлагать пути их преодоления
<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>	
Уровень 2	критерии идентификации экономических рисков различной природы
Уровень 2	проводить идентификацию экономических рисков различной природы

1.4 Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной

программы

Математика: теория вероятностей и математическая статистика

Экономическая безопасность

Страхование

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
<b>Общая трудоемкость дисциплины</b>	<b>5 (180)</b>	<b>5 (180)</b>
<b>Контактная работа с преподавателем:</b>	<b>2 (72)</b>	<b>2 (72)</b>
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		
<b>Самостоятельная работа обучающихся:</b>	<b>2 (72)</b>	<b>2 (72)</b>
изучение теоретического курса (ТО)		
расчетно-графические задания, задачи (РГЗ)		
реферат, эссе (Р)		
курсовое проектирование (КП)	Нет	Нет
курсовая работа (КР)	Нет	Нет
<b>Промежуточная аттестация (Экзамен)</b>	<b>1 (36)</b>	<b>1 (36)</b>

### 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	Концептуальные основы оценки рисков	12	12	0	24	ОПК-1 ПК-40
2	Аналитические методы оценки рисков	12	12	0	24	ОПК-1 ПК-31
3	Оценка рисков на основе имитационного моделирования	12	12	0	24	ОПК-1 ПК-32
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	Риск как экономическая категория. Социально-культурные аспекты риска	4	0	0
2	1	Классификация рисков	4	0	0
3	1	Организационные основы оценки и управления рисками	4	0	0
4	2	Концепция "стоимости под риском" и её приложения	4	0	0

5	2	Аналитические методы оценки портфельного риска	4	0	0
6	2	Аналитические методы оценки риска деривативов	4	0	0
7	3	Моделирование флуктуаций стоимости финансовых и нефинансовых активов	4	0	0
8	3	Организация, проведение и интерпретация результатов вычислительного эксперимента в сфере оценки рисков	4	0	0
9	3	Мультиагентный подход в моделировании финансовых рисков	4	0	0
Итого			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	Риск как экономическая категория. Социально-культурные аспекты риска	4	0	0
2	1	Классификация рисков	4	0	0
3	1	Организационные основы оценки и управления рисками	4	0	0
4	2	Концепция "стоимости под риском" и её приложения	4	0	0
5	2	Аналитические методы оценки портфельного риска	4	0	0
6	2	Аналитические методы оценки риска деривативов	4	0	0
7	3	Моделирование флуктуаций стоимости финансовых и нефинансовых активов	4	0	0

8	3	Организация, проведение и интерпретация результатов вычислительного эксперимента в сфере оценки рисков	4	0	0
9	3	Мультиагентный подход в моделировании финансовых рисков	4	0	0
Всего			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
Всего					

## 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	Шоломицкий А. Г.	Теория риска. Выбор при неопределенности и моделирование риска: учебное пособие для вузов по направлению подготовки "Экономика"	Москва: ГУ ВШЭ, 2005
Л1.2	Тихомиров Н. П., Тихомирова Т. М.	Риск-анализ в экономике: [монография]	Москва: Экономика, 2010
Л1.3	Уколов А. И., Гупалова Т. Н.	Управление корпоративными рисками: инструменты хеджирования: учебное пособие	Москва: Директ-Медиа, 2014



## **8 Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)**

Непременным условием успешного освоения дисциплины является аккуратное посещение занятий. К практическим занятиям необходима подготовка, заключающаяся в изучении заданного преподавателем нормативного, учебного и научного материала (соответствующих актов законодательства, разделов учебной литературы, тематических статей в научных изданиях и т.п.). По результатам изученного материала поощряется создание презентаций, логических схем (ментальных карт), мультимедийных материалов, а также тестов.

Немаловажную часть курса составляют задачи. Они направлены как на выработку практических навыков применения нормативных методик, предполагающих вычисления, так и на формирование цифровых компетенций, навыков анализа данных и компьютерного моделирования.

Формой аттестации по дисциплине является устный экзамен, в ходе которого студент получает билет с двумя вопросами. Экзаменуемый имеет право готовить ответ в течение сорока пяти минут, не пользуясь при этом какой-либо нормативной или справочной литературой. Подготовив ответ, студент рассказывает его содержание преподавателю. Последний может задать дополнительные вопросы.

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

### **9.1 Перечень необходимого программного обеспечения**

9.1.1	¾ Microsoft Windows Professional 7 Russian Upgrade Academic ; ¾ Microsoft Office Professional Plus; ¾ ESET NOD32
-------	--

### **9.2 Перечень необходимых информационных справочных систем**

9.2.1	Справочно-правовая система "Консультант+", <a href="http://www.consultant.ru">www.consultant.ru</a>
9.2.2	База научных статей <a href="http://www.cyberleninka.ru">www.cyberleninka.ru</a>

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

Аудитория укомплектована специальной мебелью на 26 посадочных мест и следующим оборудованием для проведения занятий. 16 компьютерных рабочих мест и рабочее место преподавателя - компьютеры "Smart Master"/Samsung 943N (17 шт); проектор Panasonic F200NT, усилитель TAC Mix, power amplifier JC-8100, акустические колонки, Master Audio Panel Sanaco MAP III GB, коммутатор CER-3000 Connections; плазменная панель Panasonic TH-42PH10RK с интерактивной насадкой; экран настенный Screenline; доска магнитно-маркерная, флипчарт. Доступ к ресурсам сети Internet, доступ к информационно-образовательной среде СФУ.

Аудитория с оборудованием для проведения занятий лекционного и семинарского типов Компьютерный класс предназначен для проведения всех видов группового обучения, интерактивных лекций, семинаров, тестирования и тренинга по дисциплине. Обеспечивается возможность использовать разнообразные сценарии компьютерного обучения, применять как сетевые, так и локальные (однопользовательские обучающие) программы и тренажеры.