

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)

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

Форма обучения

очная

Год набора

2019

Красноярск 2022

## РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Программу составили \_\_\_\_\_

канд.эконом.наук, Доцент, Прокопович Дмитрий Алексеевич

должность, инициалы, фамилия

## 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

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	подходы к математической формализации задач оценки рисками проводить математическую формализацию задач оценки рисков
<b>ПК-31: способностью на основе статистических данных исследовать социально-экономические процессы в целях прогнозирования возможных угроз экономической безопасности</b>	
ПК-31: способностью на основе статистических данных исследовать социально-экономические процессы в целях прогнозирования возможных угроз экономической безопасности	подходы к исследованию моделей оценки рисков проводить исследование моделей оценки рисков на устойчивость
<b>ПК-32: способностью проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности</b>	
ПК-32: способностью проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности	методы оценки экономических рисков проводить оценку экономических рисков
<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</b>	

**компенсационные резервы**

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

подходы к выявлению факторов риска и к снижению подверженности риску  
качественно и количественно оценивать уровень риска

**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. Концептуальные основы оценки рисков</b>									
	1. Риск как экономическая категория. Социально-культурные аспекты риска	4	4						
	2. Риск как экономическая категория. Социально-культурные аспекты риска			4	4				
	3. Риск как экономическая категория. Социально-культурные аспекты риска							8	
	4. Классификация рисков	4	4						
	5. Классификация рисков			4	4				
	6. Классификация рисков							8	
	7. Организационные основы оценки и управления рисками	4	4						
	8. Организационные основы оценки и управления рисками			4	4				

9. Организационные основы оценки и управления рисками							8	
<b>2. Аналитические методы оценки рисков</b>								
1. Концепция "стоимости под риском" и её приложения	4	4						
2. Концепция "стоимости под риском" и её приложения			4	4				
3. Концепция "стоимости под риском" и её приложения							8	
4. Аналитические методы оценки портфельного риска	4	4						
5. Аналитические методы оценки портфельного риска			4	4				
6. Аналитические методы оценки портфельного риска							8	
7. Аналитические методы оценки риска деривативов	4	4						
8. Аналитические методы оценки риска деривативов			4	4				
9. Аналитические методы оценки риска деривативов							8	
<b>3. Оценка рисков на основе имитационного моделирования</b>								
1. Моделирование флуктуаций стоимости финансовых и нефинансовых активов	4	4						
2. Моделирование флуктуаций стоимости финансовых и нефинансовых активов			4	4				
3. Моделирование флуктуаций стоимости финансовых и нефинансовых активов							8	
4. Организация, проведение и интерпретация результатов вычислительного эксперимента в сфере оценки рисков	4	4						
5. Организация, проведение и интерпретация результатов вычислительного эксперимента в сфере оценки рисков			4	4				

6. Организация, проведение и интерпретация результатов вычислительного эксперимента в сфере оценки рисков							8	
7. Мультиагентный подход в моделировании финансовых рисков	4	4						
8. Мультиагентный подход в моделировании финансовых рисков			4	4				
9. Мультиагентный подход в моделировании финансовых рисков							8	
Всего	36	36	36	36			72	



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

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

1. Кузнецова О. В. Инструментальный анализ рисков при принятии управленческих решений: учебное пособие(Архангельск: САФУ).
2. Турчаева И. Н. Оценка рисков: практикум: Практикум(Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М").
3. Бурменко Р. Р. Оценка рисков: учебно-методическое пособие (Красноярск: СФУ).

### **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.  $\frac{3}{4}$  Microsoft Windows Professional 7 Russian Upgrade Academic ;  $\frac{3}{4}$  Microsoft Office Professional Plus;  $\frac{3}{4}$  ESET NOD32

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

1. Справочно-правовая система "Консультант+", [www.consultant.ru](http://www.consultant.ru)
2. База научных статей [www.cyberleninka.ru](http://www.cyberleninka.ru)

## **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)**

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 Panei 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.