

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

Б1.О.32.01 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)

38.05.01.32 Финансовые и институциональные механизмы обеспечения
экономической безопасности и управления рисками

Форма обучения

заочная

Год набора

2022

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
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: Формирует предложения для решения задач оценки эффективности и прогнозирования финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующего субъекта, а также выявления, предупреждения, локализации и нейтрализации внутренних и внешних угроз и рисков	принципы и методы оценки эффективности финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующего субъекта прогнозировать финансово-хозяйственную деятельность хозяйствующего субъекта с целью повышения ее эффективности. приёмами выявления и разработки предложений по предупреждению, локализации и нейтрализации внутренних и внешних угроз и рисков финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующего субъекта

1.4 Особенности реализации дисциплины

Язык реализации дисциплины: Русский.

Дисциплина (модуль) реализуется с применением ЭО и ДОТ

URL-адрес и название электронного обучающего курса: <https://e.sfu-kras.ru/course/view.php?id=31115>.

2. Объем дисциплины (модуля)

Вид учебной работы	Всего, зачетных единиц (акад. час)	Семестр					
		1	2	3	4	5	6

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. Концептуальные основы оценки рисков									
	1. Риск как экономическая категория. Социально-культурные аспекты риска	1							
	2. Риск как экономическая категория. Социально-культурные аспекты риска							16	8
	3. Классификация рисков	1							
	4. Классификация рисков			1					
	5. Классификация рисков							16	8
	6. Организационные основы оценки и управления рисками	1							
	7. Организационные основы оценки и управления рисками			1					
	8. Организационные основы оценки и управления рисками							15	8
2. Аналитические методы оценки рисков									

1. Концепция "стоимости под риском" и её приложения	1							
2. Концепция "стоимости под риском" и её приложения			1					
3. Концепция "стоимости под риском" и её приложения							18	8
4. Аналитические методы оценки портфельного риска	1							
5. Аналитические методы оценки портфельного риска			1					
6. Аналитические методы оценки портфельного риска							18	8
7. Аналитические методы оценки риска деривативов	1							
8. Аналитические методы оценки риска деривативов			1					
9. Аналитические методы оценки риска деривативов							18	8
3. Оценка рисков на основе имитационного моделирования								
1. Моделирование флуктуаций стоимости финансовых и нефинансовых активов	1							
2. Моделирование флуктуаций стоимости финансовых и нефинансовых активов			1					
3. Моделирование флуктуаций стоимости финансовых и нефинансовых активов							18	8
4. Организация, проведение и интерпретация результатов вычислительного эксперимента в сфере оценки рисков	1							
5. Организация, проведение и интерпретация результатов вычислительного эксперимента в сфере оценки рисков			1					
6. Организация, проведение и интерпретация результатов вычислительного эксперимента в сфере оценки рисков							18	8
7. Мультиагентный подход в моделировании финансовых рисков			1					

8. Мультиагентный подход в моделировании финансовых рисков							18	8
Всего	8		8				155	72

4 Учебно-методическое обеспечение дисциплины

4.1 Печатные и электронные издания:

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

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
2. База научных статей 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 ТАС 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.