


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

СОГЛАСОВАНО
Заведующий кафедрой
Бухгалтерского учета, анализа и
аудита

 А.Т. Петрова

« 28 » июня 2018г.
Торгово-экономический институт

УТВЕРЖДАЮ
Заведующий кафедрой
Бухгалтерского учета, анализа и
аудита

 А.Т. Петрова

« 28 » июня 2018г.
Торгово-экономический институт

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
АНАЛИЗ РИСКОВ**

Дисциплина Б1.В.ДВ.4.2 Анализ рисков

Направление подготовки 38.04.01 Экономика

Магистерская программа 38.04.01.11 «Бизнес-аналитик»

форма обучения очная

год набора 2018

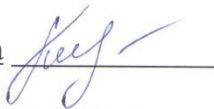
Красноярск 2018

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

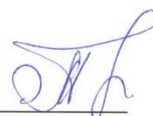
составлена в соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по укрупненной группе 38.00.00 ЭКОНОМИКА И УПРАВЛЕНИЕ

Направления подготовки /специальность (профиль/специализация)
38.04.01 Экономика магистерская программа 38.04.01.11 «Бизнес-аналитик»

Программу составили Т.В. Живаева



Заведующий кафедрой (разработчик) А.Т.Петрова



« 28 » июня 2018г.

Рабочая программа обсуждена на заседании кафедры (выпускающая)
Бухгалтерского учета, анализа и аудита

« 28 » июня 2018г. протокол № 6

Заведующий кафедрой (выпускающей) А.Т.Петрова



1 Цели и задачи изучения дисциплины

1.1 Цель преподавания дисциплины

Целью дисциплины является формирование теоретических и практических знаний в области выявления и оценки величины и вероятности риска финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующих субъектов.

1.2 Задачи изучения дисциплины

1) изучение и обобщение материалов, содержащих теоретические аспекты анализа рисков;

2) овладение навыками:

- проведения анализа с использованием различных источников информации с целью оценки рисков;

- оценки эффективности проектов с учетом фактора риска.

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

ОК-2: Готовностью действовать в нестандартных ситуациях, нести социальную и этическую ответственность за принятые решения	
Знать:	
Уровень 1	общие тенденции и закономерности развития общества
Уровень 2	основные научные подходы к определению понятия «риск»
Уровень 3	перечень факторов, обуславливающих возникновение рисков
Уметь:	
Уровень 1	учитывать нестабильную конъюнктуру рынка при анализе рисков
Уровень 2	действовать в нестандартных ситуациях
Уровень 3	нести ответственность за принятые решения в отношении рисков
Владеть:	
Уровень 1	подходами к анализу рисков
Уровень 2	методами анализа рисков
Уровень 3	инструментарием выявления и решения проблем по минимизации рисков
ПК-1: Способностью и критически оценивать результаты, полученные отечественными и зарубежными исследователями, выявлять перспективные направления, составлять программы исследований	
Знать:	
Уровень 1	научную терминологию в области анализа рисков
Уровень 2	типовые способы построения программ исследований в области анализа рисков
Уметь:	
Уровень 1	самостоятельно анализировать научную литературу в области анализа рисков
Уровень 2	планировать научную деятельность в области анализа рисков
Уровень 3	вести поиск и обработку информации по анализу рисков
Владеть:	

Уровень 1	навыками анализа информации, необходимой для анализа рисков
Уровень 2	навыками критического восприятия информации
Уровень 3	методами и способами получения информации из различных источников для анализа рисков
ПК-3: Способностью проводить самостоятельные исследования в соответствии с разработанной программой	
Знать:	
Уровень 1	методы и принципы научного познания
Уровень 2	инструментарий исследований
Уровень 3	основные модели изучаемых экономических процессов
Уметь:	
Уровень 1	использовать общенаучные методы познания и экономической науки для решения задач исследования
Уровень 2	использовать и разрабатывать модели анализируемых процессов
Уровень 3	проводить самостоятельные исследования в соответствии с разработанной программой
Владеть:	
Уровень 1	методологией исследования
Уровень 2	навыками самостоятельного ведения научного исследования
Уровень 3	способностью обоснования научной новизны результатов исследования
ПК-8: Способностью готовить аналитические материалы для оценки мероприятий в области экономической политики и принятия стратегических решений на микро- и макроуровне	
Знать:	
Уровень 1	теоретические основы анализа рисков
Уровень 2	классификацию и виды рисков
Уровень 3	основные методы оценки рисков
Уметь:	
Уровень 1	выбирать и использовать методы оценки для конкретных видов рисков
Уровень 2	использовать современные технологии для анализа рисков
Уровень 3	работать с массивом источников, необходимых для выявления и оценки рисков
Владеть:	
Уровень 1	навыками анализа рисков
Уровень 2	критериями оценки рисков
Уровень 3	навыками построения логически выдержанных заключений по результатам анализа рисков с предложением различных вариантов управленческих решений
ДПК-1: Способностью оценивать эффективность проектов с учетом фактора неопределенности	
Знать:	
Уровень 1	понятийный аппарат оценки рисков
Уровень 2	методику анализа рисков и особенности ее реализации в зависимости от оцениваемого вида рисков
Уровень 3	экономическую сущность, методику расчета и критерии оценки показателей, используемых для оценки рисков
Уметь:	

Уровень 1	осуществлять выбор аналитических инструментов оценки рисков в условиях неопределенности
Уровень 2	осуществлять расчет показателей для обоснования оценки рисков
Уровень 3	формировать экономически обоснованные выводы по результатам анализа
Владеть:	
Уровень 1	навыками сбора исходной информации, необходимой для обоснования оценки рисков
Уровень 2	методикой обработки экономических данных в соответствии с задачами оценки рисков в условиях неопределенности
Уровень 3	навыками обоснования выводов по результатам расчета показателей оценки рисков

1.4 Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Дисциплина «Анализ рисков» входит в вариативную часть дисциплин по выбору профессионального цикла (Б1.В.ДВ.4.2).

Предшествующие дисциплины: Контроллинг, Управление ресурсами коммерческой организации.

Последующие дисциплины: Бюджетирование, Управленческий анализ, Анализ в антикризисном управлении, Инвестиционный анализ.

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.часов)	Семестр
		2
Общая трудоемкость дисциплины	2 (72)	2 (72)
Контактная работа с преподавателем:	0,89 (32)	0,89 (32)
занятия лекционного типа	0,22 (8)	0,22 (8)
занятия семинарского типа		
в том числе: семинары		
практические занятия	0,67 (24)	0,67 (24)
практикумы		
лабораторные работы		
другие виды контактной работы		

в том числе: групповые консультации		
индивидуальные консультации		
иная внеаудиторная контактная работа:		
групповые занятия		
индивидуальные занятия		
Самостоятельная работа обучающихся:	1,11 (40)	1,11 (40)
изучение теоретического курса (ТО)		
расчетно-графические задания, задачи (РГЗ)		
реферат, эссе (Р)		
курсовое проектирование (КП)	Нет	Нет
курсовая работа (КР)	Нет	Нет
Промежуточная аттестация (Зачёт)		

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	Методологические основы теории предпринимательского риска	2	2	0	12	ПК-1 ПК-3
2	Виды рисков в предпринимательской деятельности	2	4	0	10	ОК-2 ПК-3
3	Методы анализа и оценки рисков	2	12	0	6	ДПК-1 ПК-3 ПК-8
4	Методы управления рисками	2	6	0	12	ОК-2 ПК-3 ПК-8
Всего		8	24	0	40	

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	Методологические основы теории предпринимательского риска	2	0	0
2	2	Виды рисков в предпринимательской деятельности	2	0	0
3	3	Методы анализа и оценки рисков	2	2	0
4	4	Методы управления рисками	2	0	0
Всего			8	2	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	Методологические основы теории предпринимательского	2	0	0
2	2	Виды рисков в предпринимательской деятельности	4	0	0
3	3	Методы анализа и оценки рисков	12	12	0
4	4	Методы управления рисками	6	4	0
Всего			24	16	0

3.4 Лабораторные занятия

Учебным планом не предусмотрены.

4 Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Савицкая Г. В.	Анализ эффективности и рисков предпринимательской деятельности. Методологические аспекты	Москва: ИНФРА- М, 2014

5 Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации

Оценочными средствами для текущего и промежуточного контроля по дисциплине являются вопросы для собеседования, тесты, задарния реконструктивного уровня , вопросы к зачету. Оценочные средства и критерии их оценивания приведены в Фонде оценочных средств в приложении к рабочей программе.

Промежуточной формой контроля по дисциплине "Анализ рисков" является зачет, который проводится в письменной форме.

6 Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

6.1. Основная литература			
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л1.1	Савицкая Г. В.	Анализ эффективности и рисков предпринимательской деятельности. Методологические аспекты	Москва: ИНФРА-М, 2014
6.2. Дополнительная литература			
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Макарова С. Н., Ферова И. С., Янкина И. А.	Управление финансовыми рисками: монография	Красноярск: СФУ, 2014

7 Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины (модуля)

Э1	Информационно-правовой портал	http://www.base.garant.ru/
Э2	Портал "Корпоративный менеджмент"	http://www.cfin.ru

8 Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

Обучение дисциплин осуществляется с использованием контактных форм обучения и самостоятельной работы. Последняя направлена на стимулирование активности студентов по изучению теоретического и практического материала, приобретению необходимых навыков решения возникающих проблем.

В процессе изучения дисциплины используются:

- текущий контроль, предполагающий подготовку сообщений, ответы на вопросы в процессе собеседования, ответы на тестовые вопросы, выполнение заданий реконструктивного уровня;

- итоговый контроль в виде сдачи зачета по окончании изучения дисциплины.

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

9.1 Перечень необходимого программного обеспечения

9.1.1	Операционная система: Microsoft® Windows® Vista Business Russian Upgrade Academic OPEN No Level (Microsoft® Windows® XP) Лиц сертификат 45676576 от 02.07.2009, бессрочный
9.1.2	Офисный пакет: Microsoft® Office Professional Plus 2007 Russian Academic OPEN No Level Лиц сертификат 43164214 от 06.12.2007, бессрочный
9.1.3	Антивирус: ESET NOD32 Antivirus Business Edition for 2750 users Лиц сертификат EAV-0189835462 от 10.04.2017; Kaspersky Endpoint Security Лиц сертификат 2462170522081649547546 от 22.05.2017
9.1.4	Браузер: Mozilla Firefox, Google Chrome
9.1.5	Архиватор: ZIP, WinRAR

9.2 Перечень необходимых информационных справочных систем

9.2.1	1. Научная библиотека Сибирского федерального университета. Режим доступа: http://lib.sfu-kras.ru/ .
9.2.2	2. Научная Электронная Библиотека eLIBRARY.RU. Режим доступа: http://elibrary.ru/
9.2.3	3. Электронная библиотека диссертаций (ЭБД) РГБ. Режим доступа: https://www.rsl.ru/

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

10.1	508 лекционная аудитория для проведения занятий по экономическим дисциплинам (Доска учебная, потолочное крепление для проектора Wize WPA -S, проектор ViewSonic PJD5123 DLP, ноутбук Dell Inspiron 3521)
------	--