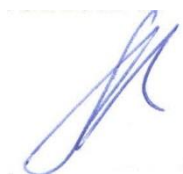


МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего
образования

«САНКТ-ПЕТЕРБУРГСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
АЭРОКОСМИЧЕСКОГО ПРИБОРОСТРОЕНИЯ»

Кафедра №85



Руководитель направления

д.э.н., проф.

должность, уч. степень, звание)

А.В. Самойлов

(подпись)

«22»_июня_ 2020 г

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

«Оценка рисков»
(Название дисциплины)

Код направления	38.05.01
Наименование направления/ специальности	Экономическая безопасность
Наименование направленности	Финансовый учет и контроль в правоохранительных органах
Форма обучения	очная

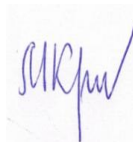
Санкт-Петербург 2020г.

Лист согласования рабочей программы дисциплины

Программу составил(а)

проф. д.т.н. проф.

должность, уч. степень, звание



подпись, дата

15.05.2020

М.Л.Кричевский

инициалы, фамилия

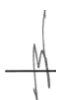
Программа одобрена на заседании кафедры № 85

«20»__05____2020 протокол №_10_

Заведующий кафедрой № 85

д.э.н., проф.

должность, уч. степень, звание



подпись, дата

20.05.2020

В.Б. Сироткин

инициалы, фамилия

Ответственный за ОП 38.05.01(05)

доц., к.э.н., доц.

должность, уч. степень, звание



подпись, дата

25.05.2020

Н.Г. Лашкова

инициалы, фамилия

Заместитель директора института (декана факультета) № 8 по методической работе

доц., к.э.н., доц.

должность, уч. степень, звание



подпись, дата

25.05.2020

Л.Г. Фетисова

инициалы, фамилия

Аннотация

Дисциплина «Оценка рисков» входит в вариативную часть образовательной программы подготовки обучающихся по специальности 38.05.01 «Экономическая безопасность» направленность «Финансовый учет и контроль в правоохранительных органах». Дисциплина реализуется кафедрой №85.

Дисциплина нацелена на формирование у выпускника

профессиональных компетенций:

ПК-4 «способность выполнять необходимые для составления экономических разделов планов расчеты, обосновывать их и представлять результаты работы в соответствии с принятыми стандартами»,

ПК-5 «способность осуществлять планово-отчетную работу организации, разработку проектных решений, разделов текущих и перспективных планов экономического развития организации, бизнес-планов, смет, учетно-отчетной документации, нормативов затрат и соответствующих предложений по реализации разработанных проектов, планов, программ»,

ПК-24 «способность оценивать эффективность формирования и использования государственных и муниципальных финансовых ресурсов, выявлять и пресекать нарушения в сфере государственных и муниципальных финансов»,

ПК-27 «способность анализировать результаты контроля, исследовать и обобщать причины и последствия выявленных отклонений, нарушений и недостатков и готовить предложения, направленные на их устранение»,

ПК-29 «способность выбирать инструментальные средства для обработки финансовой, бухгалтерской и иной экономической информации и обосновывать свой выбор»,

ПК-32 «способность проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности»,

ПК-34 «способность проводить комплексный анализ угроз экономической безопасности при планировании и осуществлении инновационных проектов»,

ПК-36 «способность составлять прогнозы динамики основных экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов»,

ПК-40 «способность 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».

Содержание дисциплины охватывает круг вопросов, связанных с изучением теоретических методов оценивания риска, которые возникают при решении различных задач. Особое внимание уделено практическим задачам, в частности, количественным методам оценки риска. Дисциплина включает нейронные сети, нечеткую логику, комбинацию указанных технологий и компьютерную практику освоения таких приемов.

Преподавание дисциплины предусматривает следующие формы организации учебного процесса: лекции, лабораторные работы, практические занятия, самостоятельная работа студента.

Программой дисциплины предусмотрены следующие виды контроля: текущий контроль успеваемости, промежуточная аттестация в форме дифференцированного зачета. Общая трудоемкость освоения дисциплины составляет 4 зачетных единицы, 144 часа.

Язык обучения по дисциплине «русский».

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине

1.1. Цели преподавания дисциплины

Формирование у студентов базовых теоретических знаний и основных практических навыков в области оценки риска и управления им. Студенты за время обучения дисциплине получают знания, позволяющие строить модели управления риском в условиях изменяющейся внешней среды, находить количественную оценку риска возможных мероприятий, принимать управленческие решения с учетом риска.

1.2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения ОП

В результате освоения дисциплины обучающийся должен обладать следующими компетенциями:

ПК-4 «способность выполнять необходимые для составления экономических разделов планов расчеты, обосновывать их и представлять результаты работы в соответствии с принятыми стандартами»:

знать - сущность экономических расчетов,

уметь - выполнять необходимые экономические расчеты,

владеть навыками - выполнения экономических расчетов, представления результатов, работы

иметь опыт деятельности - в области выполнения расчетов;

ПК-5 «способность осуществлять планово-отчетную работу организации, разработку проектных решений, разделов текущих и перспективных планов экономического развития организации, бизнес-планов, смет, учетно-отчетной документации, нормативов затрат и соответствующих предложений по реализации разработанных проектов, планов, программ»:

знать - планово-отчетную работу организации, разработку проектных решений,

уметь - составлять учетно-отчетную документацию,

владеть навыками - составления бизнес-планов,

иметь опыт деятельности - по реализации разработанных проектов, планов, программ;

ПК-24 «способность оценивать эффективность формирования и использования государственных и муниципальных финансовых ресурсов, выявлять и пресекать нарушения в сфере государственных и муниципальных финансов»:

знать - методы оценки эффективности ресурсов,

уметь - пользоваться методиками расчета эффективности финансовых ресурсов,

владеть навыками - расчета финансовых ресурсов,

иметь опыт деятельности - в сфере оценки эффективности ресурсов;

ПК-27 «способность анализировать результаты контроля, исследовать и обобщать причины и последствия выявленных отклонений, нарушений и недостатков и готовить предложения, направленные на их устранение»:

знать - методы оценки эффективности формирования и использования ресурсов,

уметь - оценивать эффективность формирования и использования государственных и муниципальных финансовых ресурсов,

владеть навыками - расчета эффективности,

иметь опыт деятельности - при выявлении и пресечении нарушения в сфере государственных и муниципальных финансов;

ПК-29 «способность выбирать инструментальные средства для обработки финансовой, бухгалтерской и иной экономической информации и обосновывать свой выбор»:

знать - инструментальные средства для обработки финансовой, бухгалтерской и иной экономической информации,
 уметь - обосновывать выбор инструментальных средств,
 владеть навыками - обработки финансовой, бухгалтерской и иной экономической информации,
 иметь опыт деятельности - в области обработки финансовой, бухгалтерской и иной экономической информации;

ПК-32 «способность проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности»:

знать - экономические риски,
 уметь - анализировать и оценивать возможные экономические риски,
 владеть навыками - расчета возможных экономических рисков,
 иметь опыт деятельности - в области расчета возможных экономических рисков;

ПК-34 «способность проводить комплексный анализ угроз экономической безопасности при планировании и осуществлении инновационных проектов»:

знать - угрозы экономической безопасности,
 уметь - проводить комплексный анализ угроз экономической безопасности,
 владеть навыками - анализа угроз экономической безопасности при планировании и осуществлении инновационных проектов,
 иметь опыт деятельности - в сфере анализа угроз экономической безопасности;

ПК-36 «способность составлять прогнозы динамики основных экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов»:

знать - сущность прогнозов динамики основных экономических показателей;
 уметь - составлять прогнозы динамики основных экономических показателей,
 владеть навыками - расчета прогнозов,
 иметь опыт деятельности - в области прогнозирования;

ПК-40 «способность 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»:

знать - экспертные методы оценки факторов риска,
 уметь - оценивать возможные экономические потери,
 владеть навыками - расчета экспертных оценок факторов риска,
 иметь опыт деятельности - в сфере расчета факторов риска.

2. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина базируется на знаниях, ранее приобретенных обучающимися при изучении следующих дисциплин:

- финансовый менеджмент;
- информационные системы в менеджменте;

Знания, полученные при изучении материала данной дисциплины, имеют как самостоятельное значение, так и используются при изучении других дисциплин:

- учет и анализ банкротств;
- комплексный экономический анализ хозяйственной деятельности

3. Объем дисциплины в ЗЕ/академ. час

Данные об общем объеме дисциплины, трудоемкости отдельных видов учебной работы по дисциплине (и распределение этой трудоемкости по семестрам) представлены в таблице 1

Таблица 1 – Объем и трудоемкость дисциплины

Вид учебной работы	Всего	Трудоемкость по семестрам
		№8
1	2	3
Общая трудоемкость дисциплины, ЗЕ/(час)	4/ 144	4/ 144
<i>Аудиторные занятия</i> , всего час., <i>В том числе</i>	68	68
лекции (Л), (час)	17	17
Практические/семинарские занятия (ПЗ), (час)	51	51
лабораторные работы (ЛР), (час)		
курсовой проект (работа) (КП, КР), (час)		
Экзамен, (час)		
<i>Самостоятельная работа</i> , всего	76	76
Вид промежуточного контроля: зачет, дифф. зачет, экзамен (Зачет, Дифф. зач, Экз.)	Дифф. Зач.	Дифф. Зач.

4. Содержание дисциплины

4.1. Распределение трудоемкости дисциплины по разделам и видам занятий

Разделы и темы дисциплины и их трудоемкость приведены в таблице 2.

Таблица 2. – Разделы, темы дисциплины и их трудоемкость

Разделы, темы дисциплины	Лекции	ПЗ (СЗ)	ЛР	СРС
Семестр №8				
Раздел 1. Основные концепции оценки риска				

Тема 1.1. Представление исходных данных	2	2	3	8
Тема 1.2. Классификация и виды рисков.	1	1	3	8
Раздел 2. Риски в экономико-финансовой области				
Тема 2.1. Рыночный риск	2	2	4	8
Тема 2.2. Кредитный риск	2	2		8
Тема 2.3. Операционный риск	1	1		4
Раздел 3 Методы оценки риска				
Тема 3.1. Стандарт ISO 31010 оценки риска	2	2	4	6
Тема 3.2. Мягкие вычисления в задачах оценки риска	2	2	12	20
Тема 3.3. Прогнозные оценки риска	2	2	8	10
Раздел 4 Управление рисками				
Тема 4.1. Управление рисками в системе менеджмента предприятия.	1	1		2
Тема 4.2. Этапы процесса управления риском	2	2		2
ИТОГО:	17	17	34	76

4.2. Содержание разделов и тем лекционных занятий

Содержание разделов и тем лекционных занятий приведено в таблице 3.

Таблица 3 - Содержание разделов и тем лекционных занятий

Номер раздела	Название и содержание разделов и тем лекционных занятий
1	<p>Раздел 1</p> <p>Тема 1.1. Представление исходных данных</p> <p>Методы представления данных. Визуализация многомерных данных. Метод главных компонент.</p> <p>Тема 1.2. Классификация и виды рисков.</p> <p>Регуляторы рисков. Классификация и виды рисков. Финансовые</p>

	риски. Стандарты в области риска. Методологии Базель-2 и Базель-3.
2	<p>Раздел 2. Риски в финансовой области</p> <p>Тема 2.1. Рыночный риск Разновидности рыночного риска. Основные модели расчета Value-at-Risk. Ковариационный метода расчета VaR. Метод исторических симуляций. Анализ сценариев.</p> <p>Тема 2.2. Кредитный риск Модели кредитного риска. Структурные модели дефолта. Модель Мертона. Оценивание в модели Мертона. <i>KMV</i>-модель. Модели, основанные на кредитной миграции.</p> <p>Тема 2.3. Операционный риск Классификация операционных рисков. Методы оценивания операционного риска. Типичные виды операционных рисков. Базовый индикаторный метод. Стандартизированный метод</p>
3	<p>Раздел 3 Методы оценки риска</p> <p>Тема 3.1. Стандарт ISO 31010 оценки риска Термины и определения. Концепции оценки риска. Процесс оценки риска. Идентификация, анализ и оценка риска. Выбор методик оценки риска.</p> <p>Тема 3.2. Мягкие вычисления в задачах оценки риска Нечеткая логика. Оценка рисков с помощью нечеткой логики. Основные понятия нечеткой логики. Функции принадлежности. . Нечеткий логический вывод. Нечеткая база правил. Основные сведения об искусственных нейронных сетях. Становление нейронной доктрины. Парадигмы обучения. Нейросетевые топологии.</p> <p>Тема 3.3. Прогнозные оценки риска Понятие о временных рядах. Стационарные и нестационарные временные ряды. Формирование прогнозных оценок. Методология Бокса-Дженкинса.</p>
4	<p>Раздел 4 Управление рисками</p> <p>Тема 4.1 Управление рисками в системе менеджмента предприятия. Объект и субъект управления рисками. Основные задачи при управлении рисками. Принципы и правила управления рисками. Формирование карты риска</p> <p>Тема 4.2 Этапы процесса управления риском Выявление (идентификация) риска, оценка риска, принятие решений, контроль риска. Информационное обеспечение процесса управление рисками. Методы управления рисками: диверсификация, страхование, хеджирование.</p>

Примечание. Все лекции проводятся с демонстрацией слайдов

4.3. Практические (семинарские) занятия

Темы практических занятий и их трудоемкость приведены в таблице 4.

Таблица 4 – Практические занятия и их трудоемкость

№ п/п	Номер раздела	Темы практических занятий, их трудоемкость.
Семестр 8		
1	1	Представление данных: матрицы объект-признак, признак-признак, построение диаграмм рассеяния, вычисление корреляций и ковариаций (3 час)
2	1	Группирование данных: матрицы расстояний, кластерный анализ, построение дендрограмм (3 час)
3	2	Моделирование случайных величин: метод Монте-Карло (3 час)
4	2	Вывод регрессионных уравнений, связывающих факторы риска в Excel и Statistica (3 час)
5	3	Построение моделей временных рядов прогноза факторов риска (3 час)
6	3	Сглаживание временных рядов в Excel и Statistica (2 час)

Примечание. ПЗ проводятся в компьютерном классе.

4.4. Лабораторные занятия

Темы лабораторных занятий и их трудоемкость приведены в таблице 5.

(

Таблица 5 – Лабораторные занятия и их трудоемкость

№ п/п	Наименование лабораторных работ	Трудоемкость, (час)	№ раздела дисциплины
Семестр 8			
1	Представление исходных данных	4	1.1
2	Визуализация многомерных данных: Метод главных компонент	4	1.2
3	Нечеткая логика в программе Matlab	4	3.1
4	Практические задачи оценки риска с помощью нечеткой логики	4	3.1
5	Искусственные нейронные сети: задача	4	3.2

	классификации рисков		
6	Искусственные нейронные сети: задача прогнозирования	4	3.2
7	Моделирование временных рядов	4	3.3
8	Модели ARIMA	4	3.3
9	Сглаживание временных рядов	2	3.3
Всего:		34	

4.5. Курсовое проектирование (работа)

Учебным планом не предусмотрено

4.6. Самостоятельная работа обучающихся

Виды самостоятельной работы и ее трудоемкость приведены в таблице 6.

Таблица 6 Виды самостоятельной работы и ее трудоемкость

Вид самостоятельной работы	Всего, час	Семестр 8, час
1	2	3
Самостоятельная работа, всего	76	76
изучение теоретического материала дисциплины (ТО)		
курсовое проектирование (КП, КР)		
расчетно-графические задания (РГЗ)		
выполнение реферата (Р)		
Подготовка к текущему контролю (ТК)		
домашнее задание (ДЗ)		
контрольные работы заочников (КРЗ)		

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

Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся указаны в п.п. 8-10.

6. Перечень основной и дополнительной литературы

6.1. Основная литература

Перечень основной литературы приведен в таблице 7.

Таблица 7 – Перечень основной литературы

Шифр	Библиографическая ссылка / URL адрес	Количество экземпляров в библиотеке (кроме электронных экземпляров)
336 К 82	Кричевский М.Л. Финансовые риски. Учебное пособие –М.: Кнорус, 2013. – 248 с.	20
005 К 82	Кричевский, М.Л. Методы исследований в менеджменте. - М.: Кнорус, 2016. -296 с	17

6.2. Дополнительная литература

Перечень дополнительной литературы приведен в таблице 8.

Таблица 8 – Перечень дополнительной литературы

Шифр	Библиографическая ссылка/ URL адрес	Количество экземпляров в библиотеке (кроме электронных экземпляров)
005 Г 65	Гончаренко, Л. П. Риск-менеджмент: учебное пособие / Л. П. Гончаренко, С. А. Филин. - М. : КноРус, 2010. - 216 с.	3
658 Б 20	Балдин, К. В. Риск-менеджмент : учебное пособие / К. В. Балдин, С. Н. Воробьев. - М. : Гардарика, 2005. - 287 с.	6

7. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети ИНТЕРНЕТ, необходимых для освоения дисциплины

Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети ИНТЕРНЕТ, необходимых для освоения дисциплины приведен в таблице 9.

Таблица 9 – Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети ИНТЕРНЕТ, необходимых для освоения дисциплины

URL адрес	Наименование
http://znanium.com/bookread.php	Риск-менеджмент инвестиционного проекта [Электронный ресурс]: учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / под ред. М. В. Грачевой, А. Б. Секерина. - М.: ЮНИТИДАНА, 2012.
http://www.znanium.com/catalog.php	Базисная система риск-менеджмент организаций реального сектора экономики: Монография / Д.В. Соколов, А.В. Барчуков. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2013.
http://www.znanium.com/catalog.php	Механизм комплексной оценки и управления рисками предприятий промышленности: Монография / М.Р. Дзагоева, А.Р. Цховребов, Л.Э. Комаева. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2014.

8. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине

8.1. Перечень программного обеспечения

Перечень используемого программного обеспечения представлен в таблице 10.

Таблица 10 – Перечень программного обеспечения

№ п/п	Наименование
1	Microsoft Windows
2	Microsoft Office
3	MATLAB 8
4	Statistica 12

8.2. Перечень информационно-справочных систем

Перечень используемых информационно-справочных систем представлен в таблице 11.

Таблица 11 – Перечень информационно-справочных систем

№ п/п	Наименование
1	ЭБС «ZNANIUM»
2	ЭБС «ЛАНЬ»

9. Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине

Состав материально-технической базы представлен в таблице 12.

Таблица 12 – Состав материально-технической базы

№ п/п	Наименование составной части материально-технической базы
1	Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа – укомплектована специализированной (учебной) мебелью, набором демонстрационного оборудования и учебно-наглядными пособиями, обеспечивающими тематические иллюстрации, соответствующие рабочим учебным программам дисциплин (модулей).
2	Аудитория (лаборатория) для проведения лабораторных работ – Аудитория укомплектована специализированной мебелью, техническими средствами обучения, оснащена необходимым лабораторным оборудованием.
3	Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа - укомплектована специализированной (учебной) мебелью, техническими средствами обучения, служащими для представления учебной информации.
4	Помещение для самостоятельной работы – укомплектовано специализированной (учебной) мебелью, оснащено компьютерной техникой с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечено доступом в электронную информационно-образовательную среду организации
5	Учебная аудитория для текущего контроля и промежуточной аттестации - укомплектована специализированной (учебной) мебелью, техническими средствами обучения, служащими для представления учебной информации.

10. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

10.1. Состав фонда оценочных средств приведен в таблице 13

Таблица 13 - Состав фонда оценочных средств для промежуточной аттестации

Вид промежуточной аттестации	Примерный перечень оценочных средств
Дифференцированный зачёт	Список вопросов; Тесты.

10.2. Перечень компетенций, относящихся к дисциплине, и этапы их формирования в процессе освоения образовательной программы приведены в таблице 14.

Таблица 14 – Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

Номер семестра	Этапы формирования компетенций по дисциплинам/практикам в процессе освоения ОП
ПК-4 «способность выполнять необходимые для составления экономических разделов планов расчеты, обосновывать их и представлять результаты работы в соответствии с принятыми стандартами»	
4	Финансы
4	Бухгалтерский учет
5	Финансовый учет
6	Экономический анализ
6	Учет и анализ банкротств
6	Налоги и налогообложение
6	Основы аудита
7	Финансовый менеджмент
7	Аудит
8	Оценка рисков
8	Производственная практика по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности
9	Производственная практика научно-исследовательская работа
10	Производственная практика научно-исследовательская работа
ПК-5 «способность осуществлять планово-отчетную работу организации, разработку проектных решений, разделов текущих и перспективных планов экономического развития организации, бизнес-планов, смет, учетно-отчетной документации, нормативов затрат и соответствующих предложений по реализации разработанных проектов, планов, программ»	
1	Экономическая теория
2	Экономическая теория
3	Экономика организации (предприятия)
3	Менеджмент

4	Маркетинг
4	Бухгалтерский учет
5	Финансовый учет
6	Управление организацией (предприятием)
6	Экономический анализ
6	Основы аудита
7	Аудит
8	Внутренний аудит финансово-хозяйственной деятельности фирмы
8	Оценка рисков
8	Контроль и ревизия
8	Международные стандарты учета и финансовой отчетности
9	Государственное и муниципальное управление
9	Системы государственного и муниципального управления
ПК-24 «способность оценивать эффективность формирования и использования государственных и муниципальных финансовых ресурсов, выявлять и пресекать нарушения в сфере государственных и муниципальных финансов»	
6	Основы аудита
6	Налоги и налогообложение
7	Аудит
7	Рынок ценных бумаг
8	Бюджетный учет и отчетность
8	Оценка рисков
9	Государственное и муниципальное управление
9	Противодействие преступлениям в сфере экономики
9	Системы государственного и муниципального управления
ПК-27 «способность анализировать результаты контроля, исследовать и обобщать причины и последствия выявленных отклонений, нарушений и недостатков и готовить предложения, направленные на их устранение»	
3	Менеджмент
8	Контроль и ревизия
8	Оценка рисков
10	Производственная преддипломная практика
ПК-29 «способность выбирать инструментальные средства для обработки финансовой, бухгалтерской и иной экономической информации и обосновывать свой выбор»	
4	Производственная практика по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности
5	Деньги, кредит, банки
7	Рынок ценных бумаг
7	Финансовый менеджмент
7	Информационные системы в экономике
8	Оценка рисков
8	Контроль и ревизия
8	Бюджетный учет и отчетность

10	Финансовая безопасность предприятия
10	Информационное обеспечение безопасности предпринимательства
ПК-32 «способность проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности»	
5	Страхование
5	Деньги, кредит, банки
7	Экономическая безопасность
8	Оценка рисков
8	Экономическая безопасность
9	Производственная практика научно-исследовательская работа
10	Производственная практика научно-исследовательская работа
10	Производственная преддипломная практика
ПК-34 «способность проводить комплексный анализ угроз экономической безопасности при планировании и осуществлении инновационных проектов»	
7	Экономическая безопасность
8	Экономическая безопасность
8	Оценка рисков
9	Производственная практика научно-исследовательская работа
10	Производственная практика научно-исследовательская работа
10	Производственная преддипломная практика
ПК-36 «способность составлять прогнозы динамики основных экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов»	
6	Учет и анализ банкротств
6	Экономический анализ
8	Оценка рисков
9	Производственная практика научно-исследовательская работа
9	Комплексный экономический анализ хозяйственной деятельности
10	Производственная практика научно-исследовательская работа
ПК-40 «способность 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»	
7	Рынок ценных бумаг
8	Оценка рисков
8	Организация и методика проведения налоговых проверок
8	Контроль и ревизия

9	Международное сотрудничество в борьбе с экономическими преступлениями
9	Проблемы противодействия терроризму
9	Производственная практика научно-исследовательская работа
10	Производственная практика научно-исследовательская работа

10.3. В качестве критериев оценки уровня сформированности (освоения) у обучающихся компетенций применяется шкала модульно–рейтинговой системы университета. В таблице 15 представлена 100–балльная и 4–балльная шкалы для оценки сформированности компетенций.

Таблица 15 –Критерии оценки уровня сформированности компетенций

Оценка компетенции		Характеристика сформированных компетенций
100-балльная шкала	4-балльная шкала	
$85 \leq K \leq 100$	«отлично» «зачтено»	<ul style="list-style-type: none"> - обучающийся глубоко и всесторонне усвоил программный материал; - уверенно, логично, последовательно и грамотно его излагает; - опираясь на знания основной и дополнительной литературы, тесно привязывает усвоенные научные положения с практической деятельностью направления; - умело обосновывает и аргументирует выдвигаемые им идеи; - делает выводы и обобщения; - свободно владеет системой специализированных понятий.
$70 \leq K \leq 84$	«хорошо» «зачтено»	<ul style="list-style-type: none"> - обучающийся твердо усвоил программный материал, грамотно и по существу излагает его, опираясь на знания основной литературы; - не допускает существенных неточностей; - увязывает усвоенные знания с практической деятельностью направления; - аргументирует научные положения; - делает выводы и обобщения; - владеет системой специализированных понятий.
$55 \leq K \leq 69$	«удовлетворительно» «зачтено»	<ul style="list-style-type: none"> - обучающийся усвоил только основной программный материал, по существу излагает его, опираясь на знания только основной литературы; - допускает несущественные ошибки и неточности; - испытывает затруднения в практическом применении знаний направления; - слабо аргументирует научные положения; - затрудняется в формулировании выводов и обобщений; - частично владеет системой специализированных понятий.
$K \leq 54$	«неудовлетворительно» «не зачтено»	<ul style="list-style-type: none"> - обучающийся не усвоил значительной части программного материала; - допускает существенные ошибки и неточности при рассмотрении проблем в конкретном направлении; - испытывает трудности в практическом применении знаний; - не может аргументировать научные положения; - не формулирует выводов и обобщений.

10.4. Типовые контрольные задания или иные материалы:

1. Вопросы (задачи) для экзамена (таблица 16)

Таблица 16 – Вопросы (задачи) для экзамена

№ п/п	Перечень вопросов (задач) для экзамена
	Учебным планом не предусмотрено

2. Вопросы (задачи) для зачета / дифференцированного зачета (таблица 17)

Таблица 17 – Вопросы (задачи) для зачета / дифф. зачета

№ п/п	Перечень вопросов (задач) для экзамена
1	Сущность риска.
2	Объективная и субъективная категории.
3	ГОСТ Р 51897-2002 «Менеджмент риска. Термины и определения».
4	Цели и задачи риск-менеджмента.
5	Описание риска. Карта риска.
6	Качественные и количественные оценки риска.
7	Последствия и вероятности риска.
8	Регуляторы риска. Базель-1.
9	Базель-2.
10	Введение Базель-3.
11	Особенности внедрения Базель-3 в России.
12	Классификация и виды рисков.
13	Основные методы измерения риска в финансовой сфере.
14	Разновидности рыночного риска.
15	Ковариационный метод расчета <i>VaR</i> .
16	Метод исторических симуляций.
17	Моделирование случайных величин.
18	Метод Монте-Карло при расчете <i>VaR</i> .
19	Модели оценки финансовой несостоятельности предприятия.
20	Модели Альтмана.
21	Недостатки моделей Альтмана.
22	Кредитные рейтинговые системы.
23	"Тройка" ведущих рейтинговых агентств.
24	Формирование рейтинговых агентств в России.
25	Миграция рейтингов.
26	Методология CreditMetrics.
27	Структурные модели дефолта.
28	Модель Мертона.
29	KMV-модель.
30	Пороговые модели.
31	Международный стандарт ISO/IEC 31090-2009 «Риск-менеджмент».
32	Количественные оценки риска по стандарту ISO/IEC 31090-2009 .
33	Методология CreditRisk+.
34	Классификация операционных рисков.
35	Методы оценивания операционного риска.
36	Страновой риск.
37	Методы оценки страновых рейтингов.
38	Управление кредитным риском.
39	Управление операционным риском.
40	Основы нечеткой логики.
41	Понятие о нечетких множествах.
42	Оценка риска посредством нечеткой логики.
43	Программные продукты при использовании нечеткой логики.

44	Преимущества и недостатки нечеткой логики при оценке риска.
45	Основы искусственных нейронных сетей.
46	Классификация нейронных сетей.
47	Методы обучения нейронных сетей.
48	Программные продукты при использовании нейронных сетей.
49	Нейронные сети при оценке риска.
50	Преимущества и недостатки нейронных сетей при оценке риска.

3. Темы и задание для выполнения курсовой работы / выполнения курсового проекта (таблица 18)

Таблица 18 – Примерный перечень тем для выполнения курсовой работы / выполнения курсового проекта

№ п/п	Примерный перечень тем для выполнения курсовой работы / выполнения курсового проекта
	Учебным планом не предусмотрено

4. Вопросы для проведения промежуточной аттестации при тестировании (таблица 19)

Таблица 19 – Примерный перечень вопросов для тестов

№ п/п	Примерный перечень вопросов для тестов
	Учебным планом не предусмотрено

5. Контрольные и практические задачи / задания по дисциплине (таблица 20)

Таблица 20 – Примерный перечень контрольных и практических задач / заданий

№ п/п	Примерный перечень контрольных и практических задач / заданий
	Учебным планом не предусмотрено

10.5. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и / или опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций, содержатся в Положениях «О текущем контроле успеваемости и промежуточной аттестации студентов ГУАП, обучающихся по программам высшего образования» и «О модульно-рейтинговой системе оценки качества учебной работы студентов в ГУАП».

11. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Целью дисциплины является – получение студентами необходимых знаний, умений и навыков в области формирования оценок риска в различных экономических ситуациях.

Методические указания для обучающихся по освоению лекционного материала

Основное назначение лекционного материала – логически стройное, системное, глубокое и ясное изложение учебного материала. Назначение современной лекции в рамках дисциплины не в том, чтобы получить всю информацию по теме, а в освоении фундаментальных проблем дисциплины, методов научного познания, новейших достижений научной мысли. В учебном процессе лекция выполняет методологическую,

организационную и информационную функции. Лекция раскрывает понятийный аппарат конкретной области знания, её проблемы, дает цельное представление о дисциплине, показывает взаимосвязь с другими дисциплинами.

Планируемые результаты при освоении обучающимся лекционного материала:

- получение современных, целостных, взаимосвязанных знаний, уровень которых определяется целевой установкой к каждой конкретной теме;
- получение опыта творческой работы совместно с преподавателем;
- развитие профессионально–деловых качеств, любви к предмету и самостоятельного творческого мышления.
- появление необходимого интереса, необходимого для самостоятельной работы;
- получение знаний о современном уровне развития науки и техники и о прогнозе их развития на ближайшие годы;
- научиться методически обрабатывать материал (выделять главные мысли и положения, приходить к конкретным выводам, повторять их в различных формулировках);
- получение точного понимания всех необходимых терминов и понятий.

Лекционный материал может сопровождаться демонстрацией слайдов и использованием раздаточного материала при проведении коротких дискуссий об особенностях применения отдельных тематик по дисциплине.

Структура предоставления лекционного материала:

- Изложение теоретических вопросов, связанных с рассматриваемой темой
- Описание методов и алгоритмов, применяемых для решения задач оценки риска
- Демонстрация примеров решения задач оценки риска
- Обобщение изложенного материала
- Ответы на возникающие вопросы по теме лекции.

По освоению лекционного материала имеется книга автора: Кричевский М.Л. Финансовые риски. М.: Кнорус, 2013 (в библиотеке ГУАП есть 20 экз.)

Методические указания для обучающихся по прохождению практических занятий

Практическое занятие является одной из основных форм организации учебного процесса, заключающаяся в выполнении обучающимися под руководством преподавателя комплекса учебных заданий с целью усвоения научно-теоретических основ учебной дисциплины, приобретения умений и навыков, опыта творческой деятельности.

Целью практического занятия для обучающегося является привитие обучающемуся умений и навыков практической деятельности по изучаемой дисциплине.

Планируемые результаты при освоении обучающимся практических занятий:

- закрепление, углубление, расширение и детализация знаний при решении конкретных задач;
- развитие познавательных способностей, самостоятельности мышления, творческой активности;
- овладение новыми методами и методиками изучения конкретной учебной дисциплины;
- выработка способности логического осмысления полученных знаний для выполнения заданий;

– обеспечение рационального сочетания коллективной и индивидуальной форм обучения.

Функции практических занятий:

- познавательная;
- развивающая;
- воспитательная.

По характеру выполняемых обучающимся заданий по практическим занятиям подразделяются на:

- ознакомительные, проводимые с целью закрепления и конкретизации изученного теоретического материала;
- аналитические, ставящие своей целью получение новой информации на основе формализованных методов;
- творческие, связанные с получением новой информации путем самостоятельно выбранных подходов к решению задач.

Формы организации практических занятий определяются в соответствии со специфическими особенностями учебной дисциплины и целями обучения. Они могут проводиться:

- в интерактивной форме (решение ситуационных задач, занятия по моделированию реальных условий, деловые игры, игровое проектирование, имитационные занятия, выездные занятия в организации (предприятия), деловая учебная игра, ролевая игра, психологический тренинг, кейс, мозговой штурм, групповые дискуссии);
- в не интерактивной форме (выполнение упражнений, решение типовых задач, решение ситуационных задач и другое).

Методика проведения практического занятия может быть различной, при этом важно достижение общей цели дисциплины.

Требования к проведению практических занятий

По практическим занятиям, проводимым на компьютере, выполняется отчет.

Отчет содержит постановку задачи, описание метода ее решения, полученные результаты.

Методические указания для обучающихся по прохождению лабораторных работ

В ходе выполнения лабораторных работ обучающийся должен углубить и закрепить знания, практические навыки, овладеть современной методикой и техникой эксперимента в соответствии с квалификационной характеристикой обучающегося. Выполнение лабораторных работ состоит из экспериментально-практической, расчетно-аналитической частей и контрольных мероприятий.

Выполнение лабораторных работ обучающимся является неотъемлемой частью изучения дисциплины, определяемой учебным планом и относится к средствам, обеспечивающим решение следующих основных задач у обучающегося:

- приобретение навыков исследования процессов, явлений и объектов, изучаемых в рамках данной дисциплины;
- закрепление, развитие и детализация теоретических знаний, полученных на лекциях;
- получение новой информации по изучаемой дисциплине;
- приобретение навыков самостоятельной работы с лабораторным оборудованием и приборами.

Задание и требования к проведению лабораторных работ

Перед проведением лабораторной работы обучающемуся следует внимательно ознакомиться с методическими указаниями по ее выполнению. В соответствии с заданием обучающийся должен подготовить необходимые данные, получить от преподавателя допуск к выполнению лабораторной работы, выполнить указанную последовательность действий, получить требуемые результаты, оформить и защитить отчет по лабораторной работе.

Структура и форма отчета о лабораторной работе

Отчет о лабораторной работе должен включать в себя: титульный лист, формулировку задания, теоретические положения, используемые при выполнении лабораторной работы, описание процесса выполнения лабораторной работы, полученные результаты и выводы.

Требования к оформлению отчета о лабораторной работе

По каждой лабораторной работе выполняется отдельный отчет. Титульный лист оформляется в соответствии с шаблоном (образцом) приведенным на сайте ГУАП (www.guap.ru) в разделе «Сектор нормативной документации». Текстовые и графические материалы оформляются в соответствии с действующими ГОСТами и требованиями, приведенными на сайте ГУАП (www.guap.ru) в разделе «Сектор нормативной документации».

Методические указания для обучающихся по прохождению самостоятельной работы

В ходе выполнения самостоятельной работы, обучающийся выполняет работу по заданию и при методическом руководстве преподавателя, но без его непосредственного участия.

Для обучающихся по заочной форме обучения, самостоятельная работа может включать в себя контрольную работу.

В процессе выполнения самостоятельной работы, у обучающегося формируется целесообразное планирование рабочего времени, которое позволяет им развивать умения и навыки в усвоении и систематизации приобретаемых знаний, обеспечивает высокий уровень успеваемости в период обучения, помогает получить навыки повышения профессионального уровня.

Методическими материалами, направляющими самостоятельную работу обучающихся являются:

- учебно-методический материал по дисциплине;
- методические указания по выполнению контрольных работ (для обучающихся по заочной форме обучения).

Методические указания для обучающихся по прохождению промежуточной аттестации

Промежуточная аттестация обучающихся предусматривает оценивание промежуточных и окончательных результатов обучения по дисциплине. Она включает в себя:

- экзамен – форма оценки знаний, полученных обучающимся в процессе изучения всей дисциплины или ее части, навыков самостоятельной работы, способности применять их

для решения практических задач. Экзамен, как правило, проводится в период экзаменационной сессии и завершается аттестационной оценкой «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно».

– зачет – это форма оценки знаний, полученных обучающимся в ходе изучения учебной дисциплины в целом или промежуточная (по окончании семестра) оценка знаний обучающимся по отдельным разделам дисциплины с аттестационной оценкой «зачтено» или «не зачтено».

– дифференцированный зачет – это форма оценки знаний, полученных обучающимся при изучении дисциплины, при выполнении курсовых проектов, курсовых работ, научно-исследовательских работ и прохождении практик с аттестационной оценкой «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно».

Система оценок при проведении промежуточной аттестации осуществляется в соответствии с требованиями Положений «О текущем контроле успеваемости и промежуточной аттестации студентов ГУАП, обучающихся по программы высшего образования» и «О модульно-рейтинговой системе оценки качества учебной работы студентов в ГУАП».

Лист внесения изменений в рабочую программу дисциплины

Дата внесения изменений и дополнений. Подпись внесшего изменения	Содержание изменений и дополнений	Дата и № протокола заседания кафедры	Подпись зав. кафедрой