

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Шебзухова Татьяна Александровна

Должность: Директор Пятигорского института (филиал) Северо-Кавказского

федерального университета

Дата подписания: 06.10.2023 14:49:35

Уникальный программный ключ:

d74ce93cd40e39275c3ba2f58486412a1c8ef961

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное автономное
образовательное учреждение высшего образования
«СЕВЕРО-КАВКАЗСКИЙ ФЕДЕРАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»
Пятигорский институт (филиал) СКФУ

УТВЕРЖДАЮ
Директор института
Т.А. Шебзухова

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Системный анализ и оценка факторов риска экономической безопасности

(ЭЛЕКТРОННЫЙ ДОКУМЕНТ)

Специальность

Направленность (профиль)

38.05.01 Экономическая безопасность

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

Квалификация выпускника

Форма обучения

Очная

Год начала обучения

2021 г.

Изучается в 7 семестре

Пятигорск, 2021

1. Цель и задачи освоения дисциплины

Программа дисциплины «Системный анализ и оценка факторов риска экономической безопасности» предназначена для студентов специальности 38.05.01 «Экономическая безопасность».

Цель дисциплины «Системный анализ и оценка факторов риска экономической безопасности» - сформировать совокупность теоретических знаний в области системного подхода и системного анализа проблем обеспечения экономической безопасности; ознакомить студентов с возможностью прикладного использования методов системного анализа для решения задач обеспечения экономической безопасности.

Задачи:

- сформировать знания о сущности, принципах, законах системного подхода и системного анализа;
- ознакомить с современными приложениями методического инструментария системного анализа для оценки факторов риска экономической безопасности;
- привить навыки использования системного анализа для подготовки необходимых для составления экономических разделов планов расчетов с учетом рисков экономической безопасности.

2. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина «Системный анализ и оценка факторов риска экономической безопасности» относится к обязательным дисциплинам базовой части блока ОП ВО. Ее освоение происходит в 7 семестре.

3. Связь с предшествующими дисциплинами

Дисциплина является последующей для дисциплины: «Исследование систем управления экономической безопасностью», «Экономическая безопасность внешнеэкономической деятельности организации», «Правовое регулирование внешнеэкономической деятельности», «Статистика», «Экономический анализ».

4. Связь с последующими дисциплинами

Дисциплина является предшествующей для дисциплин: «Разработка стратегии обеспечения экономической безопасности на макро-, мезо- и микроуровнях», «Мониторинг и прогнозирование рисков и угроз экономической безопасности».

5. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесённых с планируемыми результатами освоения образовательной программы

5.1 Наименование компетенции

Код	Формулировка:
ОК-8	способностью принимать оптимальные организационно-управленческие решения
ПК-25	способностью оценивать эффективность систем внутреннего контроля и аудита
ПК-27	способностью анализировать результаты контроля, исследовать и обобщать причины и последствия выявленных отклонений, нарушений и недостатков и готовить предложения, направленные на их устранение
ПК-32	способностью проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности

5.2 Знания, умения, навыки и (или) опыт деятельности, характеризующие этапы формирования компетенций

Планируемые результаты обучения по дисциплине, характеризующие этапы формирования компетенций	Формируемые компетенции
Знать: основные категории и понятия теории управления организацией, необходимые для разработки организационно-управленческих решений.	ОК-8
Знать: комплексную систему оценки эффективности систем внутреннего контроля и аудита	ПК-25
Знать: требования к обобщению результатов исследования; комплексные способы выявления недостатков и причин их возникновения; последствия выявленных отклонений, нарушений и недостатков;	ПК-27
Знать: основные экономические риски и угрозы экономической безопасности; состав и методы оценки основных экономических рисков и угроз экономической безопасности.	ПК-32
Уметь: применять понятийно- категориальный аппарат, основные законы управления организацией в решении профессиональных задач.	ОК-8
Уметь: комплексно оценивать эффективность систем внутреннего контроля и аудита	ПК-25
Уметь: оценивать достоверность полученной информации; анализировать экономические показатели деятельности хозяйствующих субъектов; выявлять причины отклонений, вероятные последствия и предлагать пути устранения недостатков.	ПК-27
Уметь: осуществлять оценку экономических рисков	ПК-32
Владеть: навыками ситуационного анализа и обоснования управленческих решений	ОК-8
Владеть: устойчивыми комплексными навыками оценки эффективности систем внутреннего контроля и аудита	ПК-25
Владеть: навыками проверки качества и достоверности полученной информации, приемами анализа и обнаружения конкретных причин возникновения нарушений; навыками определения последствий для экономики хозяйствующего субъекта; навыками разработки мер по устранению негативных последствий.	ПК-27
Владеть: методикой прогнозирования динамики развития основных угроз экономической безопасности; методикой оценки уровня рисков и угроз экономической безопасности; навыками обоснования прогнозов динамики развития основных угроз экономической безопасности.	ПК-32

6. Объем учебной дисциплины

	Астр. часов	
Объем занятий: Итого	135 ч.	5 з.е.
В т.ч. аудиторных	40,5 ч.	
Из них:		
Лекций	13,5 ч.	
Практических занятий	27 ч.	
Самостоятельной работы	67,5 ч.	
Экзамен 7 семестр	27	

7. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества астрономических часов и видов занятий

7.1 Тематический план дисциплины

№ тем ы	Раздел (тема) дисциплины	Реализуем ые компетенц ии	Контактная работа обучающихся с преподавателем, часов (астр.)		Самостоятельная работа, часов
			Лекции	Практические занятия	
7 семестр					
1	Тема: 1 Понятие и классификация рисков	ОК-8, ПК-25, ПК-27, ПК-32	1,5	3	67,5
2	Тема: 2 Теоретические основы исследования рисков экономической безопасности: классические и современные аспекты	ОК-8, ПК-25, ПК-27, ПК-32	1,5	3	
3	Тема: 3 Система выявления рисков экономической безопасности	ОК-8, ПК-25, ПК-27, ПК-32	3	6	
4	Тема: 4 Схемы оценки рисков экономической безопасности в условиях неопределенности	ОК-8, ПК-25, ПК-27, ПК-32	1,5	3	
5	Тема: 5 Инструменты количественной оценки рисков экономической безопасности	ОК-8, ПК-25, ПК-27, ПК-32	1,5	3	
6	Тема: 6 Система управления рисками экономической безопасности	ОК-8, ПК-25, ПК-27, ПК-32	1,5	3	
	Тема: 7 Методы управления рисками экономической безопасности	ОК-8, ПК-25, ПК-27, ПК-32	1,5	3	
	Тема: 8 Принятие решений по результатам оценки рисков экономической безопасности	ОК-8, ПК-25, ПК-27, ПК-32	1,5	3	
	Итого за 7 семестр		13,5	27	67,5

7.2 Наименование и содержание лекций

№ темы дисци- плин ы	Наименование тем дисциплины, их краткое содержание	Объем часов (астр.)	Интерактивная форма проведения
7 семестр			
1	Понятие и классификация рисков Категории «риск» и «неопределенность»: понятие и сущность. Экономическая природа рисков. Система рисков и их классификация.	1,5	Лекция-беседа
2	Теоретические основы исследования рисков экономической безопасности: классические и современные аспекты Характеристика основных концепций риска. Анализ и синтез теоретических взглядов на риск.	1,5	
3	Система выявления рисков экономической безопасности Информационное обеспечение системы выявления рисков.	1,5	Мультимедиа-лекция
3	Основные подходы к выявлению риска.	1,5	
4	Схемы оценки рисков экономической безопасности в условиях неопределенности Матрицы последствий и рисков. Анализ решений в условиях неопределенности. Решение оптимизационных задач.	1,5	
5	Инструменты количественной оценки рисков экономической безопасности Общие подходы к количественной оценке риска. Доходность и волатильность. Коэффициенты бета и альфа. Показатель value at risk (VaR)	1,5	
6	Система управления рисками экономической безопасности Общие принципы управления рисками. Цели и задачи системы управления рисками. Этапы управления риском.	1,5	Мультимедиа-лекция
7	Методы управления рисками экономической безопасности Уклонение от риска. Диверсификация. Страхование рисков. Лимитирование.	1,5	
8	Принятие решений по результатам оценки рисков экономической безопасности Понятие управленческого решения. Критерии принятия решения. Принятие решений в условиях неопределенности. Использование матричных методов в принятии управленческих решений в условиях риска. Матрица Стрикленда-Томпсона в принятии управленческих решений. Оценка эффективности управленческих решений в условиях риска	1,5	
Итого за 7 семестр		13,5	4,5

7.3 Наименование лабораторных работ

Данный вид работы не предусмотрен учебным планом.

7.4 Наименование практических занятий

№ темы дисци- плин ы	Наименование тем практических занятий	Объем часов (астр.)	Интерактивная форма проведения
----------------------------------	---------------------------------------	---------------------------	--------------------------------------

7 семестр			
Тема: 1 Понятие и классификация рисков			
1	Практическое занятие №1. Категории «риск» и «неопределенность»: понятие и сущность. Экономическая природа рисков.	1,5	
1	Практическое занятие №2. Система рисков и их классификация.	1,5	Решение разноуровневых задач (заданий)
Тема: 2 Теоретические основы исследования рисков экономической безопасности: классические и современные аспекты			
2	Практическое занятие №3. Характеристика основных концепций риска.	1,5	
2	Практическое занятие №4. Анализ и синтез теоретических взглядов на риск.	1,5	
Тема: 3 Система выявления рисков экономической безопасности			
3	Практическое занятие №5. Информационное обеспечение системы выявления рисков.	1,5	
3	Практическое занятие №6. Информационное обеспечение системы выявления рисков.	1,5	
3	Практическое занятие №7. Основные подходы к выявлению риска.	1,5	
3	Практическое занятие №8. Основные подходы к выявлению риска.	1,5	Решение разноуровневых задач (заданий)
Тема: 4 Схемы оценки рисков экономической безопасности в условиях неопределенности			
4	Практическое занятие №9. Матрицы последствий и рисков. Анализ решений в условиях неопределенности.	1,5	
4	Практическое занятие №10. Решение оптимизационных задач.	1,5	Решение разноуровневых задач (заданий)
Тема: 5 Инструменты количественной оценки рисков экономической безопасности			
5	Практическое занятие №11. Общие подходы к количественной оценке риска. Доходность и волатильность.	1,5	
5	Практическое занятие №12. Коэффициенты бета и альфа. Показатель value at risk (VaR)	1,5	
Тема: 6 Система управления рисками экономической безопасности			
6	Практическое занятие №13. Общие принципы управления рисками. Цели и задачи системы управления рисками.	1,5	
6	Практическое занятие №14. Этапы управления риском.	1,5	Решение разноуровневых задач (заданий)
Тема: 7 Методы управления рисками экономической безопасности			
7	Практическое занятие №15. Уклонение от риска. Диверсификация.	1,5	
7	Практическое занятие №16. Страхование рисков. Лимитирование.	1,5	
Тема: 8 Принятие решений по результатам оценки рисков экономической безопасности			
8	Практическое занятие №17. Понятие управленческого решения. Критерии принятия решения. Принятие решений в условиях неопределенности. Использование матричных методов в принятии управленческих решений в условиях риска.	1,5	
8	Практическое занятие №18. Матрица Стрикленда-Томпсона в принятии управленческих решений. Оценка эффективности	1,5	

	управленческих решений в условиях риска.		
	Итого за 7 семестр	27	6

7.5 Технологическая карта самостоятельной работы студента

Код реализуемых компетенций	Вид деятельности студентов	Итоговый продукт самостоятельной работы	Средства и технологии оценки	Объем часов, в том числе (астр.)		
				СРС	Контактная работа с преподавателем	Всего
7 семестр						
ОК-8, ПК-25, ПК-27, ПК-32	Самостоятельное изучение литературы по теме № 1-8	Текст конспекта	Собеседование	45,36	5,04	50,4
ОК-8, ПК-25, ПК-27, ПК-32	Подготовка к практическим занятиям	Отчет	Собеседование	7,29	0,81	8,1
ОК-8, ПК-25, ПК-27, ПК-32	Написание курсовой работы	Курсовая работа	Собеседование	8,1	0,9	9
Итого за 7 семестр				60,75	6,75	67,5
ОК-8, ПК-25, ПК-27, ПК-32	Подготовка к экзамену	Устный ответ на поставленный вопрос (задание)	Собеседование	24,3	2,7	27

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

8.1 Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения ОП ВО. Паспорт фонда оценочных средств

Код оцениваемой компетенции	Этап формирования компетенции (№ темы)	Средства и технологии оценки	Вид контроля, аттестация (текущий/промежуточный)	Тип контроля (устный, письменный или с использованием технических средств)	Наименование оценочного средства
7 семестр					
ОК-8, ПК-25, ПК-27, ПК-32	1-8	Собеседование	Текущий	Устный, письменный	Вопросы для собеседования
ОК-8, ПК-25, ПК-27,	1,3,4,6	Собеседование	Текущий	Устный, письменный	Комплект разноуровневых задач

ПК-32					(заданий)
ОК-8, ПК-25, ПК-27, ПК-32	1-8	Собеседование	Промежуточный (экзамен)	Устный	Вопросы к экзамену

8.2 Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

Уровни сформированности компетенции	Индикаторы	Дескрипторы			
		2 балла	3 балла	4 балла	5 баллов
ПК-25					
Базовый	Знать: комплексную систему оценки эффективности систем внутреннего контроля и аудита.	Обучающийся не знает комплексную систему оценки эффективности систем внутреннего контроля и аудита.	Имеет слабое, ограниченное представление о комплексной системе оценки эффективности систем внутреннего контроля и аудита.	Демонстрирует достаточно полное знание комплексной системы оценки эффективности систем внутреннего контроля и аудита.	
	Уметь: комплексно оценивать эффективность систем внутреннего контроля и аудита.	Обучающийся не умеет комплексно оценивать эффективность систем внутреннего контроля и аудита.	Не в полной мере может комплексно оценивать эффективность систем внутреннего контроля и аудита.	Демонстрирует умение комплексно оценивать эффективность систем внутреннего контроля и аудита.	
	Владеть: устойчивыми комплексными навыками оценки эффективности систем внутреннего контроля и аудита.	Обучающийся не имеет устойчивых комплексных навыков оценки эффективности систем внутреннего контроля и аудита.	Не в полной мере может оценивать эффективность систем внутреннего контроля и аудита.	Демонстрирует устойчивые комплексные навыки оценки эффективности систем внутреннего контроля и аудита.	
Повышенный	Знать: комплексную систему оценки эффективности систем внутреннего контроля и аудита.				Демонстрирует глубокое и прочное знание комплексной системы оценки эффективности систем внутреннего контроля и аудита.
	Уметь: комплексно оценивать эффективность систем внутреннего контроля и аудита.				Демонстрирует умение комплексно оценивать эффективность систем внутреннего контроля и аудита.
	Владеть: устойчивыми комплексными навыками оценки эффективности систем внутреннего контроля и аудита.				Демонстрирует устойчивые комплексные навыки оценки эффективности систем внутреннего контроля и аудита.

	и аудита.				и аудита.
ПК-27					
Базовый	Знать: требования к обобщению результатов исследования; комплексные способы выявления недостатков и причин их возникновения.	Обучающийся не знает требований к обобщению результатов исследования; комплексных способов выявления недостатков и причин их возникновения.	Имеет слабое, ограниченное представление о требованиях к обобщению результатов исследования; комплексных способах выявления недостатков и причин их возникновения.	Демонстрирует достаточно полное знание требований к обобщению результатов исследования; комплексных способов выявления недостатков и причин их возникновения.	
	Уметь: оценивать достоверность полученной информации; анализировать экономические показатели деятельности хозяйствующих субъектов.	Обучающийся не умеет оценивать достоверность полученной информации; анализировать экономические показатели деятельности хозяйствующих субъектов.	Не в полной мере может оценивать достоверность полученной информации; анализировать экономические показатели деятельности хозяйствующих субъектов.	Демонстрирует умение оценивать достоверность полученной информации; анализировать экономические показатели деятельности хозяйствующих субъектов.	
	Владеть: навыками проверки качества и достоверности полученной информации, приемами анализа и обнаружения конкретных причин возникновения нарушений; навыками определения последствий для экономики хозяйствующего субъекта.	Обучающийся не имеет навыков проверки качества и достоверности полученной информации, приемами анализа и обнаружения конкретных причин возникновения нарушений; навыков определения последствий для экономики хозяйствующего субъекта.	Не в полной мере владеет навыком проверки качества и достоверности полученной информации, приемами анализа и обнаружения конкретных причин возникновения нарушений; навыками определения последствий для экономики хозяйствующего субъекта.	Демонстрирует навыки проверки качества и достоверности полученной информации, приемами анализа и обнаружения конкретных причин возникновения нарушений; навыки определения последствий для экономики хозяйствующего субъекта.	
Повышенный	Знать: требования к обобщению результатов исследования; комплексные способы выявления недостатков и причин их возникновения; последствия выявленных отклонений, нарушений и недостатков.				Демонстрирует глубокое и прочное знание требований к обобщению результатов исследования; комплексных способов выявления недостатков и причин их возникновения; последствий выявленных отклонений, нарушений и недостатков.
	Уметь: оценивать достоверность полученной информации; анализировать экономические показатели				Демонстрирует умение оценивать достоверность полученной информации; анализировать экономические

	деятельности хозяйствующих субъектов; выявлять причины отклонений, вероятные последствия и предлагать пути устранения недостатков.				показатели деятельности хозяйствующих субъектов; выявлять причины отклонений, вероятные последствия и предлагать пути устранения недостатков.
	Владеть: навыками проверки качества и достоверности полученной информации, приемами анализа и обнаружения конкретных причин возникновения нарушений; навыками определения последствий для экономики хозяйствующего субъекта; навыками разработки мер по устранению негативных последствий.				Демонстрирует навыки проверки качества и достоверности полученной информации, приемами анализа и обнаружения конкретных причин возникновения нарушений; навыками определения последствий для экономики хозяйствующего субъекта; навыками разработки мер по устранению негативных последствий.

ПК-32					
Базовый	Знать: основные экономические риски и угрозы экономической безопасности.	Обучающийся не знает основных экономических рисков и угроз экономической безопасности.	Имеет слабое, ограниченное представление об основных экономических рисках и угрозах экономической безопасности.	Демонстрирует достаточно полное знание основных экономических рисков и угроз экономической безопасности.	
	Уметь: осуществлять оценку экономических рисков.	Обучающийся не умеет осуществлять оценку экономических рисков.	Не в полной мере может осуществлять оценку экономических рисков.	Демонстрирует умение осуществлять оценку экономических рисков.	
	Владеть: методикой прогнозирования динамики развития основных угроз экономической безопасности; методикой оценки уровня рисков и угроз экономической безопасности.	Обучающийся не имеет навыков владения методикой прогнозирования динамики развития основных угроз экономической безопасности; методикой оценки уровня рисков и угроз экономической безопасности.	Не в полной мере владеет навыком владения методикой прогнозирования динамики развития основных угроз экономической безопасности; методикой оценки уровня рисков и угроз экономической безопасности.	Демонстрирует навыки владения методикой прогнозирования динамики развития основных угроз экономической безопасности; методикой оценки уровня рисков и угроз экономической безопасности.	
Повышенный	Знать: основные экономические риски и угрозы экономической безопасности; состав и методы				Демонстрирует глубокое и прочное знание основных экономических рисков и угроз экономической

	оценки основных экономических рисков и угроз экономической безопасности.				безопасности; состава и методов оценки основных экономических рисков и угроз экономической безопасности.
	Уметь: осуществлять оценку экономических рисков.				Демонстрирует умение осуществлять оценку экономических рисков.
	Владеть: методикой прогнозирования динамики развития основных угроз экономической безопасности; методикой оценки уровня рисков и угроз экономической безопасности; навыками обоснования прогнозов динамики развития основных угроз экономической безопасности.				Демонстрирует навыки владения методикой прогнозирования динамики развития основных угроз экономической безопасности; методикой оценки уровня рисков и угроз экономической безопасности; навыками обоснования прогнозов динамики развития основных угроз экономической безопасности.

ОК-8					
Базовый	Знать: основные категории и понятия теории управления организацией, необходимые для разработки организационно-управленческих решений.	Обучающийся не знает основные категории и понятия теории управления организацией, необходимые для разработки организационно-управленческих решений.	Имеет слабое, ограниченное представление об основных категориях и понятиях теории управления организацией, необходимых для разработки организационно-управленческих решений.	Демонстрирует достаточно полное знание основных категорий и понятий теории управления организацией, необходимых для разработки организационно-управленческих решений.	
	Уметь: применять понятийно-категориальный аппарат, основные законы управления организацией в решении профессиональных задач.	Обучающийся не умеет применять понятийно-категориальный аппарат, основные законы управления организацией в решении профессиональных задач.	Не в полной мере может применять понятийно-категориальный аппарат, основные законы управления организацией в решении профессиональных задач.	Демонстрирует умение применять понятийно-категориальный аппарат, основные законы управления организацией в решении профессиональных задач.	
	Владеть: навыками ситуационного анализа и обоснования управленческих решений.	Обучающийся не имеет навыков ситуационного анализа и обоснования управленческих решений.	Не в полной мере владеет навыками ситуационного анализа и обоснования управленческих решений.	Демонстрирует навыки ситуационного анализа и обоснования управленческих решений.	
Повышенный	Знать: основные категории и понятия теории управления организацией, необходимые для разработки				Демонстрирует глубокое и прочное знание основных категорий и понятий теории управления организацией,

	организационно-управленческих решений.				необходимых для разработки организационно-управленческих решений.
	Уметь: применять понятийно-категориальный аппарат, основные законы управления организацией в решении профессиональных задач.				Демонстрирует умение применять понятийно-категориальный аппарат, основные законы управления организацией в решении профессиональных задач.
	Владеть: навыками ситуационного анализа и обоснования управленческих решений.				Демонстрирует навыки ситуационного анализа и обоснования управленческих решений.

Описание шкалы оценивания

В рамках рейтинговой системы успеваемость студентов по каждой дисциплине оценивается в ходе текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации.

Текущий контроль

Рейтинговая оценка знаний студента

№ п/п	Вид деятельности студентов	Сроки выполнения	Количество баллов
1.	Практическое занятие № 8	8 неделя	25
2.	Практическое занятие № 16	16 неделя	30
Итого за 7 семестр			55

Максимально возможный балл за весь текущий контроль устанавливается равным 55. Текущее контрольное мероприятие считается сданным, если студент получил за него не менее 60% от установленного для этого контроля максимального балла. Рейтинговый балл, выставаемый студенту за текущее контрольное мероприятие, сданное студентом в установленные графиком контрольных мероприятий сроки, определяется следующим образом:

Уровень выполнения контрольного задания	Рейтинговый балл (в % от максимального балла за контрольное задание)
Отличный	100
Хороший	80
Удовлетворительный	60
Неудовлетворительный	0

Промежуточная аттестация

Промежуточная аттестация в форме экзамена предусматривает проведение обязательной экзаменационной процедуры и оценивается 40 баллами из 100. В случае если рейтинговый балл студента по дисциплине по итогам семестра равен 60, то программой автоматически добавляется 32 премиальных балла и выставляется оценка «отлично». Положительный ответ студента на экзамене оценивается рейтинговыми баллами в диапазоне от 20 до 40 ($20 \leq S_{\text{экз}} \leq 40$), оценка меньше 20 баллов считается неудовлетворительной.

Шкала соответствия рейтингового балла экзамена 5-балльной системе

Рейтинговый балл по дисциплине	Оценка по 5-балльной системе
35 – 40	Отлично

28 – 34	Хорошо
20 – 27	Удовлетворительно

Итоговая оценка по дисциплине, изучаемой в одном семестре, определяется по сумме баллов, набранных за работу в течение семестра, и баллов, полученных при сдаче экзамена:

*Шкала пересчета рейтингового балла по дисциплине
в оценку по 5-балльной системе*

<i>Рейтинговый балл по дисциплине</i>	<i>Оценка по 5-балльной системе</i>
88 – 100	Отлично
72 – 87	Хорошо
53 – 71	Удовлетворительно
<53	Неудовлетворительно

8.3 Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений и навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций

Вопросы к экзамену

Вопросы (задача, задание) для проверки уровня обученности

Базовый уровень

Знать:

1. Понятие и классификация рисков
2. Категории «риск» и «неопределенность»: понятие и сущность.
3. Экономическая природа рисков.
4. Система рисков и их классификация.
5. Сущность неопределенности в экономике.
6. Анализ и синтез теоретических взглядов на риск.
7. Система выявления рисков экономической безопасности
8. Информационное обеспечение системы выявления рисков.
9. Основные подходы к выявлению риска.
10. Метод анкетирования.
11. Графический и картографический методы.
12. Метод инспектирования.
13. Аналитический метод.
14. Сущность и содержание методов выявления рисков.
15. Схемы оценки рисков экономической безопасности в условиях неопределенности
16. Матрицы последствий и рисков.
17. Инструменты количественной оценки рисков экономической безопасности
18. Общие подходы к количественной оценке риска.
19. Коэффициенты доходности и волатильности.
20. Коэффициенты бета и альфа.
21. Показатель Value at Risk (VaR).
22. Методические аспекты и практико-ориентированные модификации подхода.
23. Меры риска, развивающие подход VaR.
24. Специфика кредитного риска.
25. Традиционные методы измерения кредитного риска.
26. Основные параметры элементов кредитного портфеля, влияющие на риск.
27. Кредитные рейтинги.
28. Зависимость вероятности дефолта от рейтинга заемщика.
29. Рейтинги Moody's, S&P.
30. Расчет вероятности дефолта и распределения убытков на основе динамики рыночных цен акций и облигаций, а также структуры капитала компании.

31. Система управления рисками экономической безопасности
32. Системный и процессный подходы к управлению рисками.
33. Общие принципы управления рисками.
34. Цели и задачи системы управления рисками.
35. Этапы управления риском.
36. Организация управления риском на производственном предприятии.
37. Этапы управления риском.
38. Методы управления рисками экономической безопасности
39. Механизмы и методы управления рисками.
40. Общая характеристика методов управления рисками.
41. Уклонение от риска.
42. Страхование как метод управления риском.
43. Основные методы страхования.
44. Положительные и отрицательные стороны.
45. Понятие хеджирования.
46. Хеджирование с помощью финансовых инструментов (опционы, форвардные контракты и пр.).
47. Лимитирование, резервирование и диверсификация как методы управления риском.
48. Методы уклонения от риска и его компенсации.
49. Методы управления финансовым риском.
50. Понятие и классификация рисков в страховом бизнесе.
51. Хеджирование рисков.
52. Принцип объединения риска или диверсификация (риск портфеля ценных бумаг).
53. Страхование, определение и виды.
54. Принятие решений по результатам оценки рисков экономической безопасности
55. Понятие управленческого решения.
56. Критерии принятия решения.
57. Принятие решений в условиях неопределенности.
58. Использование матричных методов в принятии управленческих решений в условиях риска.

Уметь, владеть:

1. Охарактеризовать категории «риск» и «неопределенность».
2. Проведите анализ теоретических основ исследования рисков экономической безопасности: классические и современные аспекты
3. Охарактеризовать основные концепции риска.
4. Выявить особенности классической теории экономического риска.
5. Выявить особенности неоклассической теории экономического риска.
6. Оценить риски в условиях полной неопределенности.
7. Оценить риски в условиях частичной неопределенности.
8. Проведите анализ основных подходов к измерению рыночного риска показателем Value at Risk (VaR): дельта-нормальный метод, метод исторического моделирования и метод Монте-Карло.
9. Приведите примеры с использованием вероятностей дефолта, матриц миграций и кредитных спрэдов.

Повышенный уровень

Знать:

1. Причины (природа) неопределенности и риска в экономике.
2. Основные подходы к разграничению неопределенности и риска.
3. Характерные черты неопределенности, критическая неопределенность и риск.

4. Уровень освещенности теории предпринимательских рисков в трудах современных экономистов.
5. Историческое развитие взглядов ведущих экономистов на понятие риска.
6. Особенности решения оптимизационных задач.
7. Типы моделей банкротств и их различие.
8. Кредит-скоринговая модель Альтмана.
9. Структурная модель Мертона: основные допущения, моделирование дефолта.
10. Принципы вывода формулы Мертона — Блэка — Шоулза.
11. Модели динамической интенсивности дефолтов.
12. Кривая кумулятивной вероятности дефолта (зависимость от временного горизонта).
13. Аутсорсинг управления риском.
14. Общая характеристика информации, необходимой для управления риском.
15. Идентификация и анализ рисков.
16. Договор страхования.
17. Страхование по системе пропорциональной ответственности.
18. Риски, не подвергаемые страховке.
19. Хеджирование.
20. Срочный контракт (фьючерс).
21. Опцион как инструмент хеджирования риска. Определение и типы.
22. Европейский и американский опцион
23. Риски и гарантии участников лизинговой сделки.
24. Факторы как метод передачи риска.
25. Матрица Стрикленда-Томпсона в принятии управленческих решений.

Уметь, владеть:

1. Проанализировать взгляды экономистов на теорию циклов и кризисов.
2. Оценить вероятность рискованных событий.
3. Оценить последствия наступления рискованных ситуаций.
4. Провести интегральную оценку рисков.
5. Выявить связь между ненаблюдаемыми и наблюдаемыми переменными.
6. Провести анализ результатов развития предприятия в условиях быстро меняющейся внешней среды.
7. Выявить особенности опциона.
8. Оценить эффективность управленческих решений в условиях риска.

8.4 Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций

Процедура проведения экзамена осуществляется в соответствии с Положением о проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся по образовательным программам высшего образования в СКФУ.

В экзаменационный билет включаются три теоретических вопроса: два вопроса для базового уровня и третий вопрос для повышенного уровня.

Ответ студента на вопросы билета должен демонстрировать знания, приобретенные на лекционных и семинарских занятиях, а также полученные посредством изучения обязательной литературы по курсу. Студент должен высказывать собственную возможность анализировать прочитанную обязательную и дополнительную литературу, в том числе на основе концепций, изученных на лекционных и семинарских занятиях.

Для подготовки по билету отводится 30 минут.

При подготовке к ответу студенту не предоставляется право пользования дополнительными источниками информации.

Критерии оценивания результатов самостоятельной работы: текста конспекта

приведены в Фонде оценочных средств по дисциплине «Системный анализ и оценка факторов риска экономической безопасности».

9. Методические рекомендации для студентов по изучению дисциплины

На первом этапе необходимо ознакомиться с рабочей программой дисциплины, в которой рассмотрено содержание тем практических занятий, темы и виды самостоятельной работы. По каждому виду самостоятельной работы предусмотрены определённые формы отчетности.

Для успешного освоения дисциплины, необходимо выполнить следующие виды самостоятельной работы, используя рекомендуемые источники информации:

№ п/п	Виды самостоятельной работы	Рекомендуемые источники информации (№ источника)			
		Основная	Дополнительная	Методическая	Интернет- ресурсы
1	Самостоятельное изучение литературы по темам № 1-8	1-2	1-2	1-2	1
2	Подготовка к практическим занятиям	1-2	1-2	1-2	1
3	Подготовка к экзамену	1-2	1-2	2	1

10. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

10.1. Перечень основной и дополнительной литературы, необходимой для освоения дисциплины:

10.1.1. Перечень основной литературы:

1. Пименов, Н. А. Налоговые риски в системе экономической безопасности : учебник для студентов вузов, обучающихся по направлению подготовки «Экономика» (квалификация (степень) «бакалавр») / Н. А. Пименов. — Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2017. — 351 с. — ISBN 978-5-238-02704-3. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/83038.html>— Режим доступа: для авторизир. Пользователей
2. Уколов, А.И. Оценка рисков : учебник / А.И. Уколов. — 2-е изд. стер. — Москва : Директ-Медиа, 2018. — 627 с. : ил., схем., табл. — Режим доступа: по подписке. — URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=445268> — Библиогр. в кн. — ISBN 978-5-4475-2589-7. — DOI 10.23681/445268. — Текст : электронный.

10.1.2. Перечень дополнительной литературы:

1. Черняков, М.К. Управление рисками: конспект лекций : [16+] / М.К. Черняков, М.М. Чернякова ; под ред. М.К. Чернякова ; Новосибирский государственный технический университет. — Новосибирск : Новосибирский государственный технический университет, 2018. — 144 с. : ил., табл. — Режим доступа: по подписке. — URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=574663> — Библиогр. в кн. — ISBN 978-5-7782-3746-9. — Текст : электронный.
2. Экономическая безопасность : учебник / под ред. В.Б. Мантусова, Н.Д. Эриашвили ; Российская таможенная академия. — 4-е изд., перераб. и доп. — Москва : Юнити, 2018. — 568 с. : ил. — Режим доступа: по подписке. — URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=496884> — Библиогр. в кн. — ISBN 978-5-238-03072-2. — Текст : электронный.

10.2. Перечень учебно-методического обеспечения самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

1. Методические указания по выполнению практических работ по дисциплине «Системный

- анализ и оценка факторов риска экономической безопасности»;
2. Методические указания по организации и проведению самостоятельной работы по дисциплине «Системный анализ и оценка факторов риска экономической безопасности»;

10.3. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины

Интернет-ресурсы:

1. <https://www.zakonrf.info/> - Кодексы и законы - правовая навигационная система.

Электронные библиотечные системы:

1. <http://biblioclub.ru/> - Университетская библиотека ONLINE.
2. <http://www.iprbookshop.ru> – Электронная библиотечная система «IPRbooks».

Профессиональные базы данных:

1. <https://pravo.ru/> - правовой информационный портал
2. <http://rapsinews.ru/> - РАПСИ - Российское агентство правовой и судебной информации

11. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем

Информационные справочные системы:

1. Справочно-правовая система **Консультант Плюс.**

Программное обеспечение

Microsoft Windows 7 Профессиональная – лицензия №61541869

Microsoft Office – лицензия №61541869

12. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине

1. Мультимедийная аудитория для проведения лекционных занятий №640: учебная мебель, доска магнитно-маркерная 1-элементная 120*240, мультимедиа-проектор Epson, учебно-наглядные пособия.
2. Аудитория для проведения практических занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации №618: учебная мебель, доска магнитно-маркерная, Интроскоп Astrophysics XIS-5335, Сканер ручной рентгеновский скрытых полостей Ватсон, Арочный металлодетектор Кордон С2, Ручной досмотровый металлоискатель общего применения «Сфинкс ВМ-611», Досмотровое складное зеркало с подсветкой, предназначено для досмотрово-поисковой работы CS-MP, Персональный комплект для обследования автотранспорта «Гастроль-П».
3. Аудитория для самостоятельной работы №606: Учебная мебель, доска кл. 3-х створчатая, компьютер в сборе -18 шт., Аудитория подключена к сети «Интернет», имеется доступ к электронным библиотечным системам и электронной информационно-образовательной среде университета.

13. Особенности освоения дисциплины лицами с ограниченными возможностями здоровья

Обучающимся с ограниченными возможностями здоровья предоставляются специальные учебники, учебные пособия и дидактические материалы, специальные технические средства обучения коллективного и индивидуального пользования, услуги ассистента (помощника), оказывающего обучающимся необходимую техническую помощь, а также услуги сурдопереводчиков и тифлосурдопереводчиков.

Освоение дисциплины (модуля) обучающимися с ограниченными возможностями здоровья может быть организовано совместно с другими обучающимися, а так же в отдельных группах.

Освоение дисциплины (модуля) обучающимися с ограниченными возможностями здоровья осуществляется с учетом особенностей психофизического развития, индивидуальных возможностей и состояния здоровья.

В целях доступности получения высшего образования по образовательной программе лицами с ограниченными возможностями здоровья при освоении дисциплины (модуля) обеспечивается:

- 1) для лиц с ограниченными возможностями здоровья по зрению:
 - присутствие ассистента, оказывающий студенту необходимую техническую помощь с учетом индивидуальных особенностей (помогает занять рабочее место, передвигаться, прочитать и оформить задание, в том числе, записывая под диктовку),
 - письменные задания, а также инструкции о порядке их выполнения оформляются увеличенным шрифтом,
 - специальные учебники, учебные пособия и дидактические материалы (имеющие крупный шрифт или аудиофайлы),
 - индивидуальное равномерное освещение не менее 300 люкс,
 - при необходимости студенту для выполнения задания предоставляется увеличивающее устройство;
- 2) для лиц с ограниченными возможностями здоровья по слуху:
 - присутствие ассистента, оказывающий студенту необходимую техническую помощь с учетом индивидуальных особенностей (помогает занять рабочее место, передвигаться, прочитать и оформить задание, в том числе, записывая под диктовку),
 - обеспечивается наличие звукоусиливающей аппаратуры коллективного пользования, при необходимости обучающемуся предоставляется звукоусиливающая аппаратура индивидуального пользования;
 - обеспечивается надлежащими звуковыми средствами воспроизведения информации;
- 3) для лиц с ограниченными возможностями здоровья, имеющих нарушения опорно-двигательного аппарата (в том числе с тяжелыми нарушениями двигательных функций верхних конечностей или отсутствием верхних конечностей)
 - письменные задания выполняются на компьютере со специализированным программным обеспечением или надиктовываются ассистенту;
 - по желанию студента задания могут выполняться в устной форме.