



Теория риска и моделирование рисков ситуаций

рабочая программа дисциплины (модуля)

Закреплена за кафедрой	Финансы и кредит Направление 38.03.01 - РФ, 580100 - КР Экономика Профиль "Математические методы в экономике"
Квалификация	Бакалавр
Форма обучения	очная
Программу составил(и):	преподаватель, Звягин К.

Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	6 (3.2)		Итого	
	Неделя			
Вид занятий	уп	рп	уп	рп
Лекции	18	18	18	18
Практические	18	18	18	18
Контактная работа	0,2	0,2	0,2	0,2
В том числе инт.	12	12	12	12
Итого ауд.	36	36	36	36
Контактная работа	36,2	36,2	36,2	36,2
Сам. работа	35,8	35,8	35,8	35,8
Итого	72	72	72	72

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ	
1.1	Формирование у студентов системы знаний в области анализа рисков, оценки эффективности управления ими, а также разработки механизмов совершенствования инструментов системы риск-менеджмента на основе моделирования рисков операций в экономической и финансовой сфере.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП	
Цикл (раздел) ООП:	Б1.В.ДВ.06
2.1	Требования к предварительной подготовке обучающегося:
2.1.1	Базы данных
2.1.2	Маркетинг
2.1.3	Методы социально-экономического прогнозирования
2.1.4	Мировая экономика
2.1.5	Основы финансовых вычислений
2.1.6	Финансы
2.1.7	Эконометрика
2.1.8	Экономико-математическое моделирование
2.1.9	Алгоритмизация и программирование экономических задач
2.1.10	Макроэкономика
2.1.11	Менеджмент
2.1.12	Учебная практика по получению первичных профессиональных умений и навыков, в том числе первичных умений и навыков научно-исследовательской деятельности
2.1.13	Экономика предприятия
2.1.14	Бухгалтерский учет
2.2	Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:
2.2.1	Оптимальное управление в экономике
2.2.2	Производственная практика по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности
2.2.3	Профессиональные компьютерные программы
2.2.4	Бизнес-планирование
2.2.5	Институциональная экономика
2.2.6	Математические методы и модели исследования операций
2.2.7	Математические методы финансового анализа
2.2.8	Нейронные сети
2.2.9	Страхование и актуарные расчеты
2.2.10	Управление стратегиями развития
2.2.11	Научно-исследовательская работа
2.2.12	Подготовка к защите и защита выпускной квалификационной работы
2.2.13	Подготовка к сдаче и сдача государственного экзамена
2.2.14	Преддипломная практика
2.2.15	Системный анализ
2.2.16	Теория игр
3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)	
ОПК-4: способностью находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовностью нести за них ответственность	
Знать:	
Уровень 1	основы отечественного законодательства, касающиеся организационно-управленческих решений;
Уровень 2	основные положения законодательных документов и договоров, применяемых в РФ; механизм применения основных нормативно-организационных и управленческих документов
Уровень 3	основные акты об ответственности за управленческие решения.
Уметь:	
Уровень 1	оперативно находить нужную информацию в управленческих и рекомендательных документах;
Уровень 2	грамотно использовать информацию найденную в управленческих и рекомендательных документах;

	с позиций управленческо-правовых норм анализировать конкретные ситуации, возникающие в повседневной практике;
Уровень 3	анализировать и оценивать организационно-управленческие решения; принимать адекватные решения при возникновении критических, спорных ситуаций.
Владеть:	
Уровень 1	Владеет навыками применения организационно-управленческих решений в текущей профессиональной деятельности
Уровень 2	В целом успешное применение навыков коллективного обсуждения планов работ, получаемых научных результатов, наличие опыта согласования интересов сторон и урегулирования конфликтных ситуаций в команде
Уровень 3	Успешное и систематическое применение навыков коллективного обсуждения планов работ, получаемых научных результатов, согласования интересов сторон и урегулирования конфликтных ситуаций в команде
ПК-5: способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д., и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений	
Знать:	
Уровень 1	Принципы анализа, состав и содержание финансовой отчетности, а также задачи, значение и необходимость анализа финансовой отчетности для принятия управленческих решений
Уровень 2	Различные приемы, способы и методики анализа финансовой отчетности, а также раскрытие информации для принятия управленческих решения
Уровень 3	Использование результатов анализа финансовой отчетности для принятия управленческих решений при оценке рисков, разработке бизнес-плана, при бюджетировании, прогнозировании и предупреждении банкротства организации
Уметь:	
Уровень 1	Выбирать необходимую информацию из отчетности, составлять и заполнять аналитические таблицы и выражать свое мнение о достоверности финансовой отчетности
Уровень 2	Самостоятельно осуществлять анализ финансовой отчетности, заполнять аналитические таблицы, составлять аналитические обзоры и производить оценку результативности хозяйственной, финансовой и инвестиционной деятельности
Уровень 3	В соответствии с поставленной задачей проанализировать результаты альтернативных расчетов и обосновать полученные выводы при оценке предпринимательских рисков, диагностике вероятности банкротства и др. управленческих решений
Владеть:	
Уровень 1	Практическими навыками работы с отчетностью и другими источниками информации необходимыми для анализа финансовой, бухгалтерской и иной отчетности
Уровень 2	Практическими навыками выполнения анализа финансовых отчетов, различными методиками анализа бухгалтерской (финансовой) отчетности, документировать и оформлять результаты анализа
Уровень 3	Владеть навыками самостоятельного принятия решений по данным анализа отчетности при разработке, смет, бюджетов, бизнес-планов и бизнес-проектов при различных вариантах правильного решения

В результате освоения дисциплины обучающийся должен

3.1	Знать:
Историю возникновения науки о риске, принципы управления рисками, стандарты в области управления рисками, систему управления рисками, «Кубик» COSO, классификацию рисков, рекомендации и требования международного и кыргызского законодательства в области управления рисками, этапы процесса управления рисками и методы управления рисками.	
3.2	Уметь:
На основе данных доходности и безрисковой ставки рассчитать вероятность дефолта по инструменту. Провести сравнительный анализ двух компаний с точки зрения уровня ликвидности. Построить ковариационную матрицу для определения оптимальной валютной структуры портфеля. Рассчитать величину под риском (VaR) для портфеля ценных бумаг. 5. На основании финансовой отчетности рассчитать коэффициенты риска согласно нормам и требованиям НБКР.	
3.3	Владеть:
Построения скорринговой модели для оценки кредитного риска контрагентов. Выбора оптимальной валютной структуры портфеля. Анализа основных характеристик финансовых инструментов для определения их оптимальных долей в портфеле. Анализа финансовой отчетности компании с точки зрения оценки платежеспособности.	