

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

Институт экономики, государственного управления и финансов

СОГЛАСОВАНО  
Заведующий кафедрой  
Социально-экономического  
планирования  
\_\_\_\_\_  
Е.В.Зандер  
« 05 » \_\_\_\_\_ 2020 г.

УТВЕРЖДАЮ  
Директор института  
\_\_\_\_\_  
Е.Б.Бухарова  
« 05 » \_\_\_\_\_ 2020 г.



### РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина Б1.В.ОД.11 Модели управления рисками при реализации государственных программ

Специальность 38.05.01 Экономическая безопасность

Специализация 38.05.01.06 Финансово-экономическое обеспечение федеральных государственных органов, обеспечивающих безопасность Российской Федерации

Форма обучения очная

Год набора 2016

Красноярск 2020

## **РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

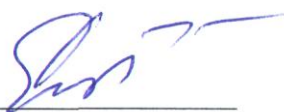
составлена в соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по укрупненной группе УГСН 38.00.00 - Экономика и управление

Специальность 38.05.01 – Экономическая безопасность

Специализация 38.05.01.06 - Финансово-экономическое обеспечение федеральных государственных органов, обеспечивающих безопасность Российской Федерации

Программу составили

к.э.н., профессор Е.Б. Бухарова



---

## 1 Цели и задачи изучения дисциплины

### 1.1 Цель преподавания дисциплины

Цель преподавания дисциплины «Модели управления рисками при реализации государственных программ» - сформировать у студентов компетенции и систему научных представлений об основных методах и экономики - математических моделях, позволяющих применять их при анализе и принятии управленческих решений в условиях конфликта и неопределенности с целью обеспечения экономической безопасности при реализации государственных программ.

### 1.2 Задачи изучения дисциплины

Задачи изучения дисциплины «Модели управления рисками при реализации государственных программ» - сформировать у студентов знания, умения и навыки в области применения экономико- математических моделей как части системы количественных методов анализа экономических процессов и принятия решений в условиях неопределенности для обеспечения экономической безопасности при реализации государственных программ.

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

<b>ПК-31: способностью на основе статистических данных исследовать социально-экономические процессы в целях прогнозирования возможных угроз экономической безопасности</b>	
Уровень 3	Знает основные теоретические модели анализа и оценки рисков.
Уровень 3	Умеет оценивать воздействие неопределенности макроэкономической среды на функционирование организаций, реализующих госпрограммы; выявлять и анализировать рыночные и специфические риски, влияющие на реализацию государственных программ
Уровень 3	Владеет математическими методами для системного анализа и моделирования влияния макроэкономической среды на принятие решений при реализации госпрограмм.
<b>ПК-32: способностью проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности</b>	
Уровень 3	Знает основные теоретические модели анализа условий и прогнозирования с учетом рисков при инвестировании и финансировании государственных программ
Уровень 3	Умеет проводить анализ влияния внешней среды и макроэкономических рыночных и специфических рисков на эффективность реализации госпрограмм на основе расчетов по экономико-математическим моделям.

Уровень 3	Владеет математическими методами системного анализа макроэкономической среды при реализации государственных программ, инструментами формирования достоверных массивов информации для аналитических и прогнозных расчетов.
-----------	---

#### 1.4 Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Для изучения курса необходимо предварительно освоить следующие дисциплины:

- Эконометрика
- Математика: Теория вероятностей и математическая статистика
- Оценка рисков
- Управление финансовыми рисками

Результаты обучения по курсу будут использоваться в дисциплинах:

- Страхование
- Практика по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности (третья)
- Налоговые и бюджетные риски
- Государственная антикоррупционная политика

#### 1.5 Особенности реализации дисциплины

Язык реализации дисциплины: русский.

Дисциплина «Модели управления рисками при реализации государственных программ» реализуется с помощью онлайн-курса «Принятие решений в условиях неопределенности социально-экономического развития» (разработан Сибирским федеральным университетом), обеспечивающим полностью формирование заявленных компетенций.

Курс размещен на образовательной платформе открытых образовательных ресурсов Stepik.org

(адрес доступа: <https://stepik.org/course/82671/promo#toc>), интегрированной с ГИС «Современная цифровая образовательная среда РФ» (адрес доступа: <https://online.edu.ru/public/course?faces-redirect=true&cid=11215825>)

Процедура зачета курса, перечень документов, необходимых для перезачета результатов освоения онлайн-курса университетом, определены условиями Положения об использовании и зачете результатов освоения массовых открытых онлайн курсов СФУ: <http://about.sfu-kras.ru/node/9653>.

## 2. Объем дисциплины (модуля)

Вид учебной работы	Всего, зачетных единиц (акад. часов)	Семестр
		9
<b>Общая трудоемкость дисциплины</b>	<b>3 (108)</b>	<b>3 (108)</b>
<b>Контактная работа с преподавателем:</b>	<b>1 (36)</b>	<b>1 (36)</b>
занятия лекционного типа	0,5 (18)	0,5 (18)
занятия семинарского типа		
в том числе: семинары		
практические занятия	0,5 (18)	0,5 (18)
практикумы		
лабораторные работы		
другие виды контактной работы		
в том числе: групповые консультации		
индивидуальные консультации		
иная внеаудиторная контактная работа:		
групповые занятия		
индивидуальные занятия		
<b>Самостоятельная работа обучающихся:</b>	<b>2 (72)</b>	<b>2 (72)</b>
изучение теоретического курса (ТО)		
расчетно-графические задания, задачи (РГЗ)		
реферат, эссе (Р)		
курсовое проектирование (КП)	Нет	Нет
курсовая работа (КР)	Нет	Нет
<b>Промежуточная аттестация (Зачёт)</b>		

### 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 подходы к анализу и оценке влияния рисков макроэкономической среды на реализацию государственных программ. Классификация рисков.	2	2	0	12	ПК-31
2	Модели и методы анализа и прогнозирования экономических систем в условиях неопределенности и риска.	8	8	0	30	ПК-31 ПК-32
3	Процесс управления рисками при реализации госпрограмм: процедуры идентификации рисков и выбор механизмов адаптации.	8	8	0	30	ПК-31 ПК-32
Всего		18	18	0	72	

### 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 подходы к анализу и оценке влияния рисков макроэкономической среды на реализацию государственных программ.	2	0	2
2	2	Модели и методы анализа, прогнозирования и оценки влияния рисков макроэкономической среды на реализацию государственных программ.	8	0	8
3	3	Процесс управления рисками при реализации госпрограмм; процедуру идентификации рисков и выбор механизмов адаптации.	8	0	8
Всего			18	0	18

### 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	Риски управления. Понятие риска и его сущность. Классификация рисков.	2	0	2
2	2	Модели и методы анализа, прогнозирования и оценки влияния рисков макроэкономической среды на реализацию госпрограмм.	8	0	8
3	3	Процесс управления рисками при реализации госпрограмм: процедуры идентификации и выбор механизмов адаптации.	8	0	8
Всего			18	0	18

### 3.4 Лабораторные занятия

№ п/п	№ раздела дисциплины	Наименование занятий	Объем в акад. часах		
			Всего	в том числе, в инновационной форме	в том числе, в электронной форме
Всего					

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

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л1.1	Булавчук А. М., Бухарова Е. Б., Ганчукова О. В.	Анализ экономико-математических моделей микроуровня: учебное пособие	Красноярск: Сибирский федеральный университет [СФУ], 2011
Л1.2	Бухарова Е. Б., Самусенко С. А., Зимнякова Т. С.	Экономика Красноярского края: система региональной экономической безопасности в условиях кризиса"	Красноярск: СФУ, 2016

### 5 Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации

Оценочные средства находятся в Приложении 1 к рабочей программе дисциплины и банке заданий к онлайн курсу «Принятие решений в условиях неопределенности социально-экономического развития» (адрес доступа: <https://stepik.org/course/82671/promo#toc>)

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

6.1. Основная литература			
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л1.1	Якунин Ю. Ю.	Системный анализ и принятие решений: учеб.-метод. пособие для лаб. работ для студентов спец. 220100.62 «Системный анализ и управление»	Красноярск: СФУ, 2012
Л1.2	Рыхтикова Н.А.	Анализ и управление рисками организации: Учебное пособие	Москва: Форум, 2014
Л1.3	Лабскер Л. Г., Ященко Н. А.	Теория игр в экономике: (практикум с решениями задач)	Москва: КноРус, 2014
Л1.4	Невежин В. П.	Теория игр. Примеры и задачи: учебное пособие по направлению подготовки	Москва: Форум, 2016
Л1.5	Гармаш А. Н., Орлова И. В.	Математические методы в управлении: Учебное пособие	Москва: Вузовский



6.2. Дополнительная литература			
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Островень Е. Л., Щедрина И. В.	Риск менеджмента организации	Б. м., 2009
Л2.2	Гуц А. К., Вахний Т. В.	Теория игр и защита компьютерных систем: [учебное пособие]	Омск: Издательство ОмГУ, 2013
Л2.3	Балдин К. В., Передеряев И. И., Голов Р. С.	Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия: учебное пособие	Москва: Дашков и К, 2012
6.3. Методические разработки			
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л3.1	Булавчук А. М., Бухарова Е. Б., Ганчукова О. В.	Анализ экономико-математических моделей микроуровня: учебное пособие	Красноярск: Сибирский федеральный университет [СФУ], 2011
Л3.2	Бухарова Е. Б., Самусенко С. А., Зимнякова Т. С.	Экономика Красноярского края: система региональной экономической безопасности в условиях кризиса"	Красноярск: СФУ, 2016

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

Э1	Веб-сайт Издательской Группы «Дело и Сервис»	<a href="http://subscribe.ru/catalog/economics.school.managmentdis">http://subscribe.ru/catalog/economics.school.managmentdis</a>
Э2	Экономическая библиотека ELO press	<a href="http://www.elopress.ru/index.php">http://www.elopress.ru/index.php</a>
Э3	Электронно-библиотечная система «ibooks.ru»	<a href="http://ibooks.ru">http://ibooks.ru</a>
Э4	Электронная библиотека издательского дома "Гребенников"	<a href="http://grebennikon.ru">http://grebennikon.ru</a>
Э5	Электронно-библиотечная система «ИНФРА-М» Знаниум	<a href="http://znanium.com/go.php&amp;id=416547">http://znanium.com/go.php&amp;id=416547</a>
Э6	Научная электронная библиотека	<a href="http://www.eLibrary.ru">www/eLibrary.ru</a>
Э7	ГИС СЦОС	<a href="https://online.edu.ru">https://online.edu.ru</a>

## 8 Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

1. Обучающийся в соответствии с расписанием посещает и активно работает на аудиторных занятиях. По дисциплине предусмотрены аудиторные лекционные и практические занятия по разделам в соответствии с рабочей программой.

Студент имеет возможность изучать дисциплину в онлайн формате по онлайн курсу «Принятие решений в условиях неопределенности

социально-экономического развития»

(URL: <https://online.edu.ru/public/course?faces-redirect=true&cid=11215825>)

2. Самостоятельная работа студента по изучению дисциплины и подготовке к занятиям включает:

- изучение материалов лекций и практических занятий;
- изучение материалов онлайн курса;
- изучение учебной и научной литературы из перечня основной и дополнительной литературы;
- изучение литературы, размещенной в электронно- библиотечных системах;
- изучение материалов, размещенных на иных ресурсах сети интернет: образовательных и научных порталах и базах знаний; информационных справочных системах; открытых порталах и сайтах университетов, государственных органов власти и организаций;
- выполнение домашних заданий (задачи, мини-кейсы);
- выполнение индивидуальных и групповых практических заданий по разделам курса (решение задач, анализ кейсов);
- подготовка эссе, докладов, рефератов
- подготовка презентаций;
- участие на занятиях в коллективном обсуждении результатов выполненных работ, сложных для понимания теоретических вопросов и проблем с выполнением индивидуальных заданий;
- подготовка к текущему и итоговому контролю по курсу.

3. Оценка освоения учебного материала и сформированности компетенций у студента осуществляется в рамках текущего контроля и промежуточной аттестации на основе балльного рейтинга, который рассчитывается как сумма баллов, набранных по итоговой письменной контрольной работе и рейтинга в баллах по результатам текущего контроля.

В случае онлайн обучения оценка освоения определяется на основе прохождения онлайн курса «Принятие решений в условиях неопределенности социально-экономического развития»

(URL: <https://online.edu.ru/public/course?faces-redirect=true&cid=11215825>)

4. Текущий контроль включает:

- Экспресс-опрос студентов (письменный или устный, на занятиях отводится 10-15 минут на его проведение) по тематике изучаемых разделов;
- Проверку и оценивание домашних заданий/задач по разделам дисциплины в соответствии с фондом оценочных средств;
- Задания студентом выполняются в течение семестра и сдаются пакетом за неделю до начала сессии.

Студенты заочной формы обучения сдают выполненные домашние задания в первый день сессии;

— Выполнение индивидуального задания - написание эссе по теме «Анализ внешних и внутренних факторов риска при реализации государственной программы (наименование государственной программы)»

— Определение рейтинга по текущему контролю - оценка в балльном исчислении следующих видов работ студентов:

- Письменные и устные опросы на занятиях. По каждому разделу дисциплины студент должен набрать не менее 50% баллов. Минимальное пороговое значение рейтинга – 10 баллов, максимальный рейтинг- 20 баллов;

- Выполнение домашних заданий по решению задач и мини кейсов. По каждому разделу дисциплины студент должен набрать не менее 50% баллов. Минимальное пороговое значение рейтинга – 10 баллов, максимальный рейтинг – 20 баллов.

- Выполнение индивидуального задания -написание эссе по теме «Анализ внешних и внутренних факторов риска при реализации государственной программы (наименование государственной программы)». Минимальное пороговое значение набранных баллов – 10 баллов, максимальный рейтинг – 20 баллов.

В случае онлайн обучения текущий контроль осуществляется на основе требований в рамках онлайн курса «Принятие решений в условиях неопределенности социально-экономического развития»

(URL: <https://online.edu.ru/public/course?faces-redirect=true&cid=11215825>)

5.1 Промежуточная аттестация в форме зачета по оценке освоения дисциплины и сформированности компетенций определяется на основе итоговой письменной контрольной работы с учетом рейтинга по текущему контролю или в форме итогового теста онлайн курса «Принятие решений в условиях неопределенности социально-экономического развития»

Система оценивания

<b>Наименование оцениваемого мероприятия</b>	<b>Максимальный балл</b>	<b>Коэффициент</b>
Промежуточные тесты и задачи	37	0,42
Итоговое тестирование	50	0,58
Итоговая оценка	87	1

6. Критерии формирования оценки уровня освоения дисциплины и сформированности компетенций в рамках промежуточной аттестации следующий:

«незачтено»: в интервале 0-45 набранных баллов;

«зачтено»: в интервале 46-87 набранных баллов;

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

### **9.1 Перечень необходимого программного обеспечения**

9.1.1	1.Операционные системы Microsoft Windows XP SP3, Microsoft Windows. Server 2003 sp2
9.1.2	2.Офисный пакет Microsoft Office 2007 SP3, Microsoft Office FrontPage 2007, Microsoft Office Visio 2007, Microsoft Office
9.1.3	3.Браузер: Mozilla FireFox; Internet Explorer
9.1.4	4.Архиватор: 7-ZIP
9.1.5	5.Антивирус ESET NOD32

### **9.2 Перечень необходимых информационных справочных систем**

9.2.1	
9.2.2	1.Информационно-правовая база Консультант
9.2.3	2.Информационно-правовая база ГАРАНТ_ <a href="http://garant.ru/">http://garant.ru/</a>
9.2.4	3.Российская информационно-справочная система научного цитирования РИНЦ <a href="http://www.eLibrary.ru">www.eLibrary.ru</a>
9.2.5	4.Международная база научного цитирования Scopus
9.2.6	5. Сайт федеральной службы государственной статистики
9.2.7	6. Портал Государственных программ ВФ
9.2.8	7. Портал Красноярского края. Государственные программы Красноярского края_ <a href="http://www.krskstate.ru/government/gosprog">http://www.krskstate.ru/government/gosprog</a>
9.2.9	ГИС СЦОС: <a href="https://online.edu.ru">https://online.edu.ru</a>

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

Учебные помещения представляют собой аудитории для проведения занятий лекционного и семинарского типа, текущего контроля и промежуточной аттестации и помещения для самостоятельной работы студентов с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду университета.

Аудитории укомплектованы специализированной мебелью и техническими средствами обучения, служащими для представления учебной информации большой аудитории.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду университета

## ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

### Контрольные вопросы и задания

Раздел дисциплины 1 Методологические подходы к анализу и оценке влияния рисков макроэкономической среды на реализацию государственных программ. Классификация рисков. - максимально 5 баллов.

1. Понятие риска и неопределенности в точных науках и экономике.
2. Субъективная и объективная вероятности случайного исхода? Какова связь неопределенности, вероятности исхода и риска в экономическом анализе?
3. Асимметрия экономической информации: кто сталкивается с наибольшими рисками?
4. Экспертные процедуры оценки рисков при реализации госпрограмм.
5. Опишите методы анализа рисков, основанные на экспертно-статистическом анализе.

Раздел 2. Модели и методы анализа и прогнозирования экономических систем в условиях неопределенности и риска- максимально 5 баллов -.

1. Дать классификацию экономико-математических моделей анализа и прогнозирования реализации госпрограмм в зависимости от уровня неопределенности и рисков.
2. Каким образом теоретические модели ожидаемой полезности можно использовать для оценки ликвидности информации при принятии решений в условиях риска.
3. Игровые модели анализа рисков.
4. Эвристические алгоритмы принятия решений в условиях риска при реализации госпрограмм.
5. В каких случаях для принятия решений применяется метод анализа иерархий и в чем принципиальное отличие этого метода от других математических методов, используемых при принятии решений?

Раздел 3. Процесс управления рисками при реализации госпрограмм: процедуры идентификации рисков и выбор механизмов адаптации - максимально 10 баллов.

1. Охарактеризуйте динамический и статический риски при реализации госпрограмм, приведите примеры.
2. В какой последовательности целесообразно проводить исследование рисков? В чем заключаются смысл и роль безрискового решения?
3. В чем сущность антирискерной политики?
4. Перечислите известные Вам методы анализа экономических систем, основанные на анализе чувствительности. Охарактеризуйте каждый из них.

5. Что такое равно эффективные стратегии реализации программ? Как оценить ущерб от неправильно выбранных стратегий?

6. Что такое дерево решений? Перечислите основные этапы процесса принятия решений с помощью дерева решений.

7. Охарактеризуйте организационные схемы управления рисками: разделение, передача, избежание.

8. Риск-менеджмент при управлении госпрограммами: общие черты и различия с риск менеджментом коммерческих организаций.

9. Поясните суть основных организационно-финансовых схем управления рисками: диверсификация, страхование, резервирование и запасы.

10. Каким образом осуществляется страхование рисков при реализации госпрограмм?