

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Силин Яков Петрович
Должность: Ректор
Дата подписания: 15.09.2021 17:04:40
Уникальный программный ключ:
24f866be2aca16484036a8cbb3c509a9531e605f

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

ФГБОУ ВО «Уральский государственный экономический университет»

Утверждена
на заседании кафедры

Утверждена

Советом по учебно-методическим вопросам
и качеству образования

01.12.2020 г.

протокол № 6

Зав. кафедрой Ноженко Д.Ю.

20 января 2021 г.

протокол № 6

Председатель

Карх Д.А.

(подпись)



РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Наименование дисциплины	Теория риска и моделирование рискованных ситуаций
Направление подготовки	38.04.01 Экономика
Профиль	Экономическая безопасность и управление рисками
Форма обучения	очная
Год набора	2021
Разработана:	
Доцент, к.э.н.	
Львова Майя Ивановна	

Екатеринбург
2021 г.

СОДЕРЖАНИЕ

ВВЕДЕНИЕ	3
1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ	3
2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП	3
3. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ	3
4. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ОПОП	3
5. ТЕМАТИЧЕСКИЙ ПЛАН	5
6. ФОРМЫ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ШКАЛЫ ОЦЕНИВАНИЯ	5
7. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ	7
8. ОСОБЕННОСТИ ОРГАНИЗАЦИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ ДЛЯ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ	9
9. ПЕРЕЧЕНЬ ОСНОВНОЙ И ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ УЧЕБНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ	9
10. ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ЛИЦЕНЗИОННОГО ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ИНФОРМАЦИОННЫХ СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ, ОНЛАЙН КУРСОВ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ	10
11. ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ	11

ВВЕДЕНИЕ

Рабочая программа дисциплины является частью основной профессиональной образовательной программы высшего образования - программы магистратуры, разработанной в соответствии с ФГОС ВО

ФГОС ВО	Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - магистратура по направлению подготовки 38.04.01 Экономика (приказ Минобрнауки России от 11.08.2020 г. № 939)
ПС	

1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Получение системных, структурированных базовых знаний по основам теории риска и отработка практических навыков в системе управления рисками, а также управлению в условиях кризисной ситуации общей деятельностью в государственном и муниципальном управлении на разных фазах реализации.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП

Дисциплина относится к вариативной части учебного плана.

3. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ

Промежуточный контроль	Часов					З.е.
	Всего за семестр	Контактная работа (по уч.зан.)			Самостоятельная работа в том числе подготовка контрольных и курсовых	
		Всего	Лекции	Практические занятия, включая курсовое проектирование		
Семестр 2						
Зачет с оценкой	144	16	4	12	128	4

4. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ОПОП

В результате освоения ОПОП у выпускника должны быть сформированы компетенции, установленные в соответствии ФГОС ВО.

Профессиональные компетенции (ПК)

Шифр и наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенций
аналитический	

<p>ПК-11 Формирование методологических основ интегральной системы управления рисками, формирование основных принципов разработки локальных нормативных актов по управлению рисками на уровне крупных организаций и подразделений</p>	<p>ИД-1.ПК-11 Знать:</p> <p>Теория управления изменениями</p> <p>Принципы и методы управления проектами</p> <p>Базовые концепции теории корпоративных финансов</p> <p>Результаты современных исследований по проблемам управления рисками в России и мире</p> <p>Понятия, методы и инструменты количественного и качественного анализа рисков</p> <p>Элементы методологии управления рисками</p> <p>Сущность и элементы процесса стратегического и оперативного планирования</p> <p>Современные информационные технологии и программные продукты для управления рисками</p> <p>Положения законодательства Российской Федерации, национальных и международных стандартов, руководств и лучших практик по управлению рисками, управлению непрерывностью бизнеса и в чрезвычайных ситуациях</p> <p>Требования к обеспечению сохранения коммерческой тайны</p> <p>Нормы профессиональной этики</p> <p>Нормы корпоративного управления и корпоративной культуры</p> <p>ИД-2.ПК-11 Уметь:</p> <p>Анализировать локальные нормативные акты, информацию о порядке и особенностях выполнения действий по управлению рисками и эффективность выполнения этих действий</p> <p>Разрабатывать методические материалы, локальные нормативные акты по управлению рисками</p> <p>Формулировать рекомендации по оптимизации процесса управления рисками</p> <p>Упорядочивать процесс управления рисками в целостную систему с четко определенными характеристиками и структурой</p> <p>Формировать непредвзятое мнение в решении конфликтов, связанных с вопросами управления рисками в организации</p> <p>Обрабатывать информацию по рискам в области своей профессиональной деятельности и в организации</p>
--	--

<p>ПК-11 Формирование методологических основ интегральной системы управления рисками, формирование основных принципов разработки локальных нормативных актов по управлению рисками на уровне крупных организаций и подразделений</p>	<p>ИД-3.ПК-11 Иметь практический опыт: Разработки методологических основ и экспертиза методик управления рисками, страховой и иной защиты деятельности организации Разработки и экспертизы методик управления в чрезвычайных, кризисных ситуациях и управления непрерывностью бизнеса Привлечения работников, ответственных за процесс управления рисками, для выработки решений относительно необходимости разработки новых методов управления рисками и их содержания и относительно актуализации существующих методов управления рисками Руководства группой работников, привлеченных для разработки методических материалов по управлению рисками Разработки форм отчетной документации по процессу управления рисками Согласование методологий управления рисками в организации Внедрения современных методологий управления рисками в повседневную деятельность организации Контроля методической деятельности по управлению рисками Проверки соответствия методологии управления рисками общей стратегии развития организации Реализации специальных проектов по управлению рисками по</p>
--	---

5. ТЕМАТИЧЕСКИЙ ПЛАН

Тема	Наименование темы	Всего часов	Контактная работа (по уч.зан.)			Самост. работа	Контроль самостоятельной работы
			Лекции	Лабораторные	Практические занятия		
			Часов				
Семестр 2		27					
Тема 1.	Теоретические основы изучения риска как объекта исследования	27	1		2	24	
Семестр 2		31					
Тема 2.	Принципы и методы анализа риска и принята решения	31	1		2	28	
Семестр 2		38					
Тема 3.	Количественные оценки экономического риска в условиях	38	1		3	34	
Семестр 2		32					
Тема 4.	Принятие оптимальных решений в условиях экономического риска	32	1		3	28	
Семестр 2		16					
Тема 5.	Тема 5. Сравнительная оценка вариантов решений	16			2	14	

6. ФОРМЫ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ШКАЛЫ ОЦЕНИВАНИЯ

Раздел/Тема	Вид оценочного средства	Описание оценочного средства	Критерии оценивания
Текущий контроль (Приложение 4)			

Тема 1-5	Устный опрос- собеседование Приложение 4	Использование двух видов устного опроса: фронтальный (охватывает сразу несколько студентов) и индивидуальный по темам лекции	50-100%
Тема 1-5	Реферат Приложение 4	Выполнение письменной работы по актуальной теме исследования	50-100%
Промежуточный контроль (Приложение 5)			
2 семестр (ЗаО)	Билет к зачету с оценкой Приложение 5	Два теоретических вопроса	50-100%

ОПИСАНИЕ ШКАЛ ОЦЕНИВАНИЯ

Показатель оценки освоения ОПОП формируется на основе объединения текущей и промежуточной аттестации обучающегося.

Показатель рейтинга по каждой дисциплине выражается в процентах, который показывает уровень подготовки студента.

Текущая аттестация. Используется 100-балльная система оценивания. Оценка работы студента в течение семестра осуществляется преподавателем в соответствии с разработанной им системой оценки учебных достижений в процессе обучения по данной дисциплине.

В рабочих программах дисциплин и практик закреплены виды текущей аттестации, планируемые результаты контрольных мероприятий и критерии оценки учебных достижений.

В течение семестра преподавателем проводится не менее 3-х контрольных мероприятий, по оценке деятельности студента. Если посещения занятий по дисциплине включены в рейтинг, то данный показатель составляет не более 20% от максимального количества баллов по дисциплине.

Промежуточная аттестация. Используется 5-балльная система оценивания. Оценка работы студента по окончании дисциплины (части дисциплины) осуществляется преподавателем в соответствии с разработанной им системой оценки достижений студента в процессе обучения по данной дисциплине. Промежуточная аттестация также проводится по окончании формирования компетенций.

Порядок перевода рейтинга, предусмотренных системой оценивания, по дисциплине, в пятибалльную систему.

Высокий уровень – 100% - 70% - отлично, хорошо.

Средний уровень – 69% - 50% - удовлетворительно.

Показатель оценки	По 5-балльной системе	Характеристика показателя
100% - 85%	отлично	обладают теоретическими знаниями в полном объеме, понимают, самостоятельно умеют применять, исследовать, идентифицировать, анализировать, систематизировать, распределять по категориям, рассчитать показатели, классифицировать, разрабатывать модели, алгоритмизировать, управлять, организовать, планировать процессы исследования, осуществлять оценку результатов на высоком уровне
84% - 70%	хорошо	обладают теоретическими знаниями в полном объеме, понимают, самостоятельно умеют применять, исследовать, идентифицировать, анализировать, систематизировать, распределять по категориям, рассчитать показатели, классифицировать, разрабатывать модели, алгоритмизировать, управлять, организовать, планировать процессы исследования, осуществлять оценку результатов. Могут быть допущены недочеты, исправленные студентом самостоятельно в процессе работы (ответа и т.д.)
69% - 50%	удовлетворительно	обладают общими теоретическими знаниями, умеют применять, исследовать, идентифицировать, анализировать, систематизировать, распределять по категориям, рассчитать показатели, классифицировать, разрабатывать модели, алгоритмизировать, управлять, организовать, планировать процессы исследования, осуществлять оценку результатов на среднем уровне. Допускаются ошибки, которые студент затрудняется исправить самостоятельно.
49 % и менее	неудовлетворительно	обладают не полным объемом общих теоретическими знаниями, не умеют самостоятельно применять, исследовать, идентифицировать, анализировать, систематизировать, распределять по категориям, рассчитать показатели, классифицировать, разрабатывать модели, алгоритмизировать, управлять, организовать, планировать процессы исследования, осуществлять оценку результатов. Не сформированы умения и навыки для решения
100% - 50%	зачтено	характеристика показателя соответствует «отлично», «хорошо», «удовлетворительно»
49 % и менее	не зачтено	характеристика показателя соответствует «неудовлетворительно»

7. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

7.1. Содержание лекций

<p>Тема 1. Теоретические основы изучения риска как объекта исследования</p> <p>Тема 1.</p> <p>1. Основные понятия риска</p> <p>2. Причины возникновения риска</p> <p>3. Классификация риска</p>
<p>Тема 2. Принципы и методы анализа риска и принятая решения</p> <p>Тема 2.</p> <p>1. Показатели измерения общего риска</p> <p>2. Принципы анализа риска</p> <p>3. Методы анализа риска</p>
<p>Тема 3. Количественные оценки экономического риска в условиях неопределенности</p> <p>Тема 3.</p> <p>1.1. Количественные методы оценки риска</p> <p>1.1.1. Математическое ожидание</p> <p>1.1.2. Дисперсия и среднеквадратическое отклонение</p> <p>1.1.3. VaR (Value at Risk)</p> <p>1.1.4. Полудисперсия</p> <p>1.1.5. Другие меры риска</p>
<p>Тема 4. Принятие оптимальных решений в условиях экономического риска</p> <p>Тема 4.</p> <p>Процедуры принятия решений в рискованных ситуациях</p> <p>2.1. Анализ дерева событий</p> <p>2.2. Анализ дерева решений</p> <p>2.3. Анализ «галстук-бабочка»</p> <p>2.4. Моделирование методом Монте-Карло</p> <p>2.5. Байесовский анализ и сеть Байеса</p> <p>2.6. Метод анализа иерархий</p> <p>2.7. Метод аналитических сетей</p>

7.2 Содержание практических занятий и лабораторных работ

<p>Тема 1. Теоретические основы изучения риска как объекта исследования</p> <p>Тема 1.</p> <p>1. Изучение классификационных характеристик риска</p> <p>2. Понятие и видовая структура рисков в системе экономической безопасности.</p>
<p>Тема 2. Принципы и методы анализа риска и принятая решения</p> <p>Тема 2.</p> <p>1. Основы случайных величин</p> <p>2. Теория вероятностных событий</p> <p>3. Дисперсия и ковариация</p>
<p>Тема 3. Количественные оценки экономического риска в условиях неопределенности</p> <p>Тема 3.</p> <p>1.1. Экспертные методы оценки риска</p> <p>1.1.1. Метод Дельфи</p> <p>1.1.2. Метод сценариев</p> <p>1.1.3. Мозговой штурм</p> <p>1.2. Нормативные методы идентификации риска</p>
<p>Тема 4. Принятие оптимальных решений в условиях экономического риска</p> <p>Тема 4. Инструментарий оптимальных решений в условиях экономического риска</p>
<p>Тема 5. Тема 5. Сравнительная оценка вариантов решений</p> <p>Тема 5.</p> <p>1) неопределенность, обусловленная отсутствием или недостатком информации об анализируемых процессах</p> <p>2) неопределенность, причиной которой является наличие нескольких принципов оптимальности</p>

7.3. Содержание самостоятельной работы

Тема 1. Теоретические основы изучения риска как объекта исследования
Тема 1. Теории к определениям риска: отечественный и зарубежный подходы
Тема 2. Принципы и методы анализа риска и принятая решения
Тема 2. Методологические принципы анализа риска
Тема 3. Количественные оценки экономического риска в условиях неопределенности
Тема 3. Методология количественных оценок экономического риска в условиях неопределенности
Тема 4. Принятие оптимальных решений в условиях экономического риска
Тема 4. Принятие оптимальных решений в условиях экономического риска
Тема 5. Тема 5. Сравнительная оценка вариантов решений
Тема 5. Методология неопределенности

7.3.1. Примерные вопросы для самостоятельной подготовки к зачету/экзамену
Приложение 1.

7.3.2. Практические задания по дисциплине для самостоятельной подготовки к зачету/экзамену

Приложение 2

7.3.3. Перечень курсовых работ

Не предусмотрено

7.4. Электронное портфолио обучающегося

Материалы не размещаются

7.5. Методические рекомендации по выполнению контрольной работы

Не предусмотрено

7.6 Методические рекомендации по выполнению курсовой работы

Не предусмотрено

8. ОСОБЕННОСТИ ОРГАНИЗАЦИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ ДЛЯ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ

По заявлению студента

В целях доступности освоения программы для лиц с ограниченными возможностями здоровья при необходимости кафедра обеспечивает следующие условия:

- особый порядок освоения дисциплины, с учетом состояния их здоровья;
- электронные образовательные ресурсы по дисциплине в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья;
- изучение дисциплины по индивидуальному учебному плану (вне зависимости от формы обучения);
- электронное обучение и дистанционные образовательные технологии, которые предусматривают возможности приема-передачи информации в доступных для них формах.
- доступ (удаленный доступ), к современным профессиональным базам данных и информационным справочным системам, состав которых определен РПД.

9. ПЕРЕЧЕНЬ ОСНОВНОЙ И ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ УЧЕБНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Сайт библиотеки УрГЭУ

<http://lib.usue.ru/>

Основная литература:

1. Авдийский В. И., Безденежных В. М., Дадалко А. В., Земсков В. В., Синявский Н. Г. Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов. [Электронный ресурс]: учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по направлению подготовки 38.04.01 «Экономика» (профиль — «Управление рисками, страхование и экономическая безопасность»). - Москва: ИНФРА-М, 2019. - 203 – Режим доступа: <https://znanium.com/catalog/product/1024505>

2. Грачева М. В., Секерин А. Б., Афанасьев А. М., Бабаскин С. Я., Быкова А. Г., Волков И. М., Копытин К. В., Никитин С. А., Первушин В. А., Светлов Н. М. Риск-менеджмент инвестиционного проекта. [Электронный ресурс]: учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям. - Москва: ЮНИТИ-ДАНА, 2017. - 544 – Режим доступа: <https://znanium.com/catalog/product/1028577>

3. Осипова В. А., Алексеев Н.С. Математические методы поддержки принятия решений. [Электронный ресурс]: Учебное пособие : ВО - Магистратура. - Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2020. - 134 – Режим доступа:

4. Казакова Н. А. Современный стратегический анализ.: учебник и практикум для магистратуры : для студентов вузов, обучающихся по экономическим направлениям и специальностям. - Москва: Юрайт, 2016. - 500

5. Вяткин В. Н., Гамза В. А., Маевский Ф. В. Риск-менеджмент.: учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим направлениям и специальностям. - Москва: Юрайт, 2016. -

Дополнительная литература:

1. Касьяненко Т. Г., Маховикова Г. А. Анализ и оценка рисков в бизнесе. [Электронный ресурс]: Учебник и практикум для вузов. - Москва: Юрайт, 2020. - 381 – Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/450126>

2. Исследование операций. Курс для управленческого персонала. [учебное пособие: в 2 ч.]. Ч. 1. Задачи, принципы, методология исследования операций. [Электронный ресурс]:. - Екатеринбург: [б. и.], 2012. - 1 – Режим доступа: <http://lib.usue.ru/resource/limit/books/12/e226.pdf>

3. Гамукин В. В. Бюджетные риски: среда, система, случай.: монография. - Тюмень: Издательство ТГУ, 2015. - 327

4. Гамукин В. В. Бюджетные риски: группы, виды, примеры.: монография. - Тюмень: Издательство ТГУ, 2015. - 338

5. Касьяненко Т. Г., Маховикова Г. А. Анализ и оценка рисков в бизнесе.: учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры : для студентов вузов, обучающихся по экономическим направлениям и специальностям. - Москва: Юрайт, 2017. - 381

10. ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ЛИЦЕНЗИОННОГО ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ИНФОРМАЦИОННЫХ СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ, ОНЛАЙН КУРСОВ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Перечень лицензионного программного обеспечения:

Microsoft Windows 10 .Договор № 52/223-ПО/2020 от 13.04.2020, Акт № Tr000523459 от 14.10.2020. Срок действия лицензии 30.09.2023.

Astra Linux Common Edition. Договор № 1 от 13 июня 2018, акт от 17 декабря 2018. Срок действия лицензии - без ограничения срока.

Microsoft Office 2016. Договор № 52/223-ПО/2020 от 13.04.2020, Акт № Tr000523459 от 14.10.2020 Срок действия лицензии 30.09.2023.

МойОфис стандартный. Соглашение № СК-281 от 7 июня 2017. Дата заключения - 07.06.2017. Срок действия лицензии - без ограничения срока.

Перечень информационных справочных систем, ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:

Справочно-правовая система Консультант+. Договор № 163/223-У/2020 от 14.12.2020. Срок действия лицензии до 31.12.2021

11. ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Реализация учебной дисциплины осуществляется с использованием материально-технической базы УрГЭУ, обеспечивающей проведение всех видов учебных занятий и научно-исследовательской и самостоятельной работы обучающихся:

Специальные помещения представляют собой учебные аудитории для проведения всех видов занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду УрГЭУ.

Все помещения укомплектованы специализированной мебелью и оснащены мультимедийным оборудованием спецоборудованием (информационно-телекоммуникационным, иным компьютерным), доступом к информационно-поисковым, справочно-правовым системам, электронным библиотечным системам, базам данных действующего законодательства, иным информационным ресурсам служащими для представления учебной информации большой аудитории.

Для проведения занятий лекционного типа презентации и другие учебно-наглядные пособия. обеспечивающие тематические иллюстрации.