

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о документе:

ФИО: Хоружий Людмила Ивановна

Должность: Директор института экономики и управления АПК

Дата подписания: 23.07.2023 14:33:28

Уникальный образный ключ:

1e90b132d9b04dce67585160b015dddf2cb1e6a9

МИНИСТЕРСТВО СЕЛЬСКОГО ХОЗЯЙСТВА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
РОССИЙСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АГРАРНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ –
МСХА имени К.А. ТИМИРЯЗЕВА»
(ФГБОУ ВО РГАУ - МСХА имени К.А. Тимирязева)

Институт экономики и управления АПК
Кафедра экономической безопасности, анализа и аудита



РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
Б1.В.10.12 Системный анализ рисков

для подготовки экономистов

ФГОС ВО

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Специализация: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Курс 3

Семестр 6

Форма обучения очная

Год начала подготовки 2022

Москва, 2022

Разработчики: Катков Ю.Н. к.э.н., доцент, Каткова Е.А., к.э.н., доцент



«01» июня 2022 г.

Рецензент: Хоружий Л.И., д.э.н., профессор



«01» июня 2022 г..

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки 38.05.01 Экономическая безопасность, профессиональных стандартов и учебного плана 2022 года начала подготовки

Программа обсуждена на заседании кафедры экономической безопасности, анализа и аудита
протокол № 11 от «09» июня 2022 г.

И.о. заведующий кафедрой Гупалова Т.Н., к.э.н., доцент



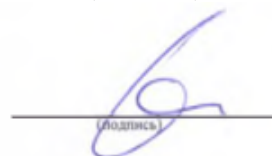
(подпись)

«09» июня 2022 г.

Согласовано:

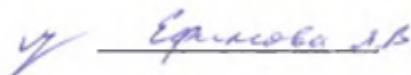
Председатель учебно-методической
комиссии института экономики и управления АПК

Корольков А.Ф., к.э.н., доцент



протокол № 10 от «30» июня 2022 г.

Заведующий отделом комплектования ЦНБ



СОДЕРЖАНИЕ

| | |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------|
| 1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ..... | 4 |
| 2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В УЧЕБНОМ ПРОЦЕССЕ | 4 |
| 3. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ, СООТНЕСЕННЫХ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ ОШИБКА! ЗАКЛАДКА НЕ ОПРЕДЕЛЕНА. | |
| 4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ | ОШИБКА! ЗАКЛАДКА НЕ ОПРЕДЕЛЕНА. |
| 4.1 РАСПРЕДЕЛЕНИЕ ТРУДОЁМКОСТИ ДИСЦИПЛИНЫ ПО ВИДАМ РАБОТ .. | ОШИБКА! ЗАКЛАДКА НЕ ОПРЕДЕЛЕНА. |
| ПО СЕМЕСТРАМ | ОШИБКА! ЗАКЛАДКА НЕ ОПРЕДЕЛЕНА. |
| 4.2 СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ..... | ОШИБКА! ЗАКЛАДКА НЕ ОПРЕДЕЛЕНА. |
| 4.3 ЛЕКЦИИ /ПРАКТИЧЕСКИЕ ЗАНЯТИЯ..... | ОШИБКА! ЗАКЛАДКА НЕ ОПРЕДЕЛЕНА. |
| 5. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ | ОШИБКА! ЗАКЛАДКА НЕ ОПРЕДЕЛЕНА. |
| 6. ТЕКУЩИЙ КОНТРОЛЬ УСПЕВАЕМОСТИ И ПРОМЕЖУТОЧНАЯ АТТЕСТАЦИЯ ПО ИТОГАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ | 15 |
| 6.1. ТИПОВЫЕ КОНТРОЛЬНЫЕ ЗАДАНИЯ ИЛИ ИНЫЕ МАТЕРИАЛЫ, НЕОБХОДИМЫЕ ДЛЯ ОЦЕНКИ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ И НАВЫКОВ И (ИЛИ) ОПЫТА ДЕЯТЕЛЬНОСТИ | 15 |
| ДЕЯТЕЛЬНОСТИ..... | 15 |
| ВОПРОСЫ К ЗАЧЕТУ ПО ДИСЦИПЛИНЕ | ОШИБКА! ЗАКЛАДКА НЕ ОПРЕДЕЛЕНА. |
| 6.2. ОПИСАНИЕ ПОКАЗАТЕЛЕЙ И КРИТЕРИЕВ КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ, ОПИСАНИЕ ШКАЛ ОЦЕНИВАНИЯ | ОШИБКА! |
| ЗАКЛАДКА НЕ ОПРЕДЕЛЕНА. | |
| 7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ..... | 29 |
| 7.1 ОСНОВНАЯ ЛИТЕРАТУРА | 29 |
| 7.2 ДОПОЛНИТЕЛЬНАЯ ЛИТЕРАТУРА..... | 29 |
| 7.3 НОРМАТИВНЫЕ ПРАВОВЫЕ АКТЫ | 30 |
| 8. ПЕРЕЧЕНЬ РЕСУРСОВ ИНФОРМАЦИОННО-ТЕЛЕКОММУНИКАЦИОННОЙ СЕТИ «ИНТЕРНЕТ», НЕОБХОДИМЫХ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ..... | 30 |
| 9. ПЕРЕЧЕНЬ ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ИНФОРМАЦИОННЫХ СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ (ПРИ НЕОБХОДИМОСТИ)..... | ОШИБКА! ЗАКЛАДКА НЕ ОПРЕДЕЛЕНА. |
| 10. ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ ОШИБКА! ЗАКЛАДКА НЕ ОПРЕДЕЛЕНА. | |
| 11. МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ СТУДЕНТАМ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ..... | 23 |
| Виды и формы отработки пропущенных занятий | 24 |
| 12. МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ ПРЕПОДАВАТЕЛЯМ ПО ОРГАНИЗАЦИИ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ..... | 24 |

АННОТАЦИЯ
рабочей программы учебной дисциплины
Б1.В.10.12 Системный анализ рисков ОПОП ВО
по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность, специализация
Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности (квалифика
ция выпускника – экономист)

Цель освоения дисциплины: является формирование у студентов профессионального мышления путем освоения методологических основ и приобретения практических навыков в области системного анализа рисков, необходимых в практической работе. Научится применять в коммуникационном процессе для ускорения передачи, обработки и интерпретации финансовой информации такие программные продукты как Excel, Word, Outlook, Power Point, Project Expert, Miro, Zoom, Trello, 1С: ERP, Битрикс24.

Место дисциплины в учебном плане: дисциплина включена в часть формируемую участниками образовательных отношений учебного плана по специальности 38.05.01 «Экономическая безопасность».

Требования к результатам освоения дисциплины: в результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции: ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3

Краткое содержание дисциплины: Понятие и сущность риска. Системный анализ и моделирование систем и процессов. Идентификация рисков. Анализ и оценка рисков. Методы управления рисками. Управление рисками на предприятии. Программное обеспечение для моделирования риска. Программное обеспечение для расчета количественной оценки риска.

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетные единицы (108 часов).

Промежуточный контроль по дисциплине: зачет с оценкой

1. Цель освоения дисциплины

Целью учебной дисциплины «Системный анализ рисков» является формирование у студентов профессионального мышления путем освоения методологических основ и приобретения практических навыков в области системного анализа рисков, необходимых в практической работе. Научится применять в коммуникационном процессе для ускорения передачи, обработки и интерпретации финансовой информации такие программные продукты как Excel, Word, Outlook, Power Point, Project Expert, Miro, Zoom, Trello, 1С: ERP, Битрикс24.

Задачами дисциплины «Системный анализ рисков» для достижения поставленной цели является формирование навыков:

- овладение современными методами принятия оптимальных управленческих решений относительно системного анализа рисков;
- овладение навыками анализа и интерпретации данных, получаемых при решении профессиональных задач в области системного анализа рисков хозяйствующего субъекта;

- овладение финансовыми и экономическими инструментальными средствами для обработки соответствующей информации в сфере системного анализа рисков в рамках обеспечения экономической безопасности;
- овладение инструментарием и навыками построения моделей для анализа и управления рисками.

2. Место дисциплины в учебном процессе

Дисциплина «Системный анализ рисков» реализуется в соответствии с требованиями ФГОС ВО, ОПОП ВО и Учебного плана по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность.

Предшествующими курсами, на которых непосредственно базируется дисциплина «Системный анализ рисков» являются «Экономическая безопасность», «Профессиональная этика», «Кадровая безопасность организаций АПК».

Дисциплина «Системный анализ рисков» является основополагающей для изучения следующих дисциплин: «Аудит», «Стратегический анализ в обеспечении экономической безопасности организаций АПК», «Контроль и ревизия», а также практики по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности, производственной практики по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности и первичных умений и навыков научно-исследовательской деятельности, преддипломной практики.

Особенностью дисциплины «Системный анализ рисков» является комплексный подход при ее изучении и прикладная направленность, позволяющая применять полученные знания по оценке и управлению различными видами рисков в рамках обеспечения экономической безопасности хозяйствующих субъектов.

Рабочая программа дисциплины «Системный анализ рисков» для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья разрабатывается индивидуально с учетом особенностей психофизического развития, индивидуальных возможностей и состояния здоровья таких обучающихся.

3. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Изучение данной учебной дисциплины направлено на формирование у обучающихся компетенций, представленных в таблице 1.

Требования к результатам освоения учебной дисциплины

| № п/п | Индекс компетенции | Содержание компетенции (или её части) | Индикаторы компетенций | В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны: | | |
|-------|--------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------|
| | | | | Знать | Уметь | Владеть |
| 1. | ПКос-1 | Способен решать стандартные профессиональные задачи, обеспечивать интегрированный подход подразделений к управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации | <p>ПКос-1.1</p> <p>Знать международные, национальные, отраслевые концепции и стандарты по управлению рисками, внутреннему контролю, аудиторской деятельности, проведению внутреннего аудита функционирования вида деятельности, бизнес-модели, процессов и процедур организации</p> | <p>- сущность и предпосылки возникновения финансовых и иных рисков в условиях рыночной экономики;</p> <p>- современные методы сбора, анализа, систематизации, оценки и интерпретации данных, необходимых для анализа рисков хозяйствующего субъекта</p> | | |
| | | | <p>ПКос-1.2</p> <p>Уметь выявлять внешний и внутренний контекст функционирования организации, составлять, описывать, обновлять карту рисков при функционировании вида деятельности, бизнес-модели, процессов и процедур организации</p> | | <p>- принимать оптимальные организационно-управленческие решения по результатам анализа рисков;</p> <p>- организовывать и проводить сбор, анализ и систематизацию информации, необходимой для выявления основных факторов риска и</p> | |

| № п/п | Индекс компетенции | Содержание компетенции (или её части) | Индикаторы компетенций | В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны: | | |
|-------|--------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | | | Знать | Уметь | Владеть |
| | | | | | оценки его уровня | |
| | | | ПКос-1.3 Владеть навыками мониторинга изменений карты рисков при функционировании вида деятельности, бизнес-модели, процессов и процедур организации | | | - современными методами принятия оптимальных управленческих решений относительно оценки и управления рисками; - навыками анализа и интерпретации данных, получаемых при решении профессиональных задач в области анализа и управления рисками хозяйствующего субъекта |
| 2. | ПКос-2 | способен анализировать информацию, с использованием информационных систем (программных продуктов) и искусственного интеллекта; выявлять причинно-следственные связи и расставлять приоритеты для дальнейших планов | ПКос-2.1 Знать методы поиска, сбора, анализа и систематизации информации с использованием информационных систем (программных продуктов) и искусственного интеллекта; оценки и | - теоретические и практические основы моделирования при анализе и управлении рисками; - возможности интернет ресурсов и программных продуктов при решении профессиональных задач (Консультант, Гарант, официальные сайты министерств и ведомств, Nalog.ru, CRM, ERP системы, Бизнес-навигатор | | |

управления рисками внутрикорпоративных злоупотреблений при функционировании вида деятельности.

| № п/п | Индекс компетенции | Содержание компетенции (или её части) | Индикаторы компетенций | В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны: | | |
|-------|--------------------|---------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | | | Знать | Уметь | Владеть |
| | | | | МСП). | | |
| | | | <p>Пкос-2.2</p> <p>Уметь анализировать с использованием информацией систем (программных продуктов) и искусственного интеллекта, оценивать и выявлять причинно-следственные связи в порядке функционирования вида деятельности, бизнес-модели, процессов и процедур организации для планирования проверки, разрабатывать регламентирующие документы по управлению рисками</p> | | <p>- анализировать и интерпретировать результаты, полученные при анализе рисков;</p> <p>- анализировать риски и их влияние на экономическую безопасность;</p> <p>- навыками распределения профессиональных задач в системе Битрикс24.</p> | |
| | | | <p>Пкос-2.3</p> <p>Владеть навыками подготовки отчетов по результатам идентификации, анализа, оценки рисков объекта проверки с использованием информационных систем (программных продуктов) и искусственного интеллекта</p> | | | <p>- инструментарием и навыками построения моделей для оценки и управления рисками;</p> <p>- навыками поиска информации посредством электронных ресурсов (Яндекс, Mail, Бизнес-навигатор МСП), официальных сайтов различных ведомств.</p> |

4. Структура и содержание дисциплины

4.1 Распределение трудоёмкости дисциплины по видам работ по семестрам

Общая трудоёмкость дисциплины составляет 3 зачетные единицы (108 часов), их распределение по видам работ представлено в таблице 2.

Таблица 2

Распределение трудоёмкости дисциплины по видам работ по семестрам

| Вид учебной работы | Трудоёмкость | |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|----------------------|
| | всего/* | в т.ч. в семестре №6 |
| Общая трудоёмкость дисциплины по учебному плану | 108 | 108 |
| 1. Контактная работа: | 68,35/24 | 68,35/24 |
| Аудиторная работа | 68,35/24 | 68,35/24 |
| <i>в том числе:</i> | | |
| <i>лекции (Л)</i> | 16/6 | 16/6 |
| <i>практические занятия (ПЗ)</i> | 52/18 | 52/18 |
| <i>контактная работа на промежуточном контроле (КРА)</i> | 0,35 | 0,35 |
| 2. Самостоятельная работа (СРС) | 39,65 | 39,65 |
| <i>самостоятельное изучение разделов, самоподготовка (проработка и повторение лекционного материала и материала учебников и учебных пособий, подготовка к практическим занятиям)</i> | 33,65 | 33,65 |
| <i>Подготовка к зачету с оценкой</i> | 6 | 6 |
| Вид промежуточного контроля: | Зачет с оценкой | |

* в том числе практическая подготовка (см. учебный план)

4.2 Содержание дисциплины

Таблица 3

Тематический план учебной дисциплины

| Наименование разделов и тем дисциплин (укрупнёно) | Всего | Аудиторная работа | | | Внеаудиторная работа СР |
|----------------------------------------------------------|-------------|-------------------|---------------|----------------|-------------------------|
| | | Л | ПЗ всего/* | ПКР всего/* | |
| Тема 1 Понятие и сущность риска | 13 | 2 | 6/2 | | 5 |
| Тема 2 Характеристика этапов системного анализа рисков | 13 | 2 | 6/2 | | 5 |
| Тема 3 Идентификация рисков | 13 | 2/2 | 6/2 | | 5 |
| Тема 4 Анализ и оценка рисков | 13 | 2/2 | 6/2 | | 5 |
| Тема 5 Методы системного анализа рисков | 15 | 2/2 | 8/2 | | 5 |
| Тема 6 Управление рисками на предприятии | 13 | 2/2 | 6/2 | | 5 |
| Тема 7 Системный анализ и моделирования сложных систем | 15 | 2/2 | 8/4 | | 5 |
| Тема 8. Моделирование и прогноз параметров риска | 12,65 | 2/2 | 6/2 | | 4,65 |
| Контактная работа на промежуточном контроле (КРА) | 0,35 | | | 0,35 | |
| Итого по дисциплине | 108 | 16/6 | 52/18 | 0,35 | 39,65 |

* в том числе практическая подготовка (см. учебный план)

Тема 1. Понятие и сущность риска

Понятия "риск" и "неопределенность". Противоречивость и альтернативность риска. Источники риска. История возникновения теории рисков и ее развитие. Маржиналистическая теория и марксистское учение о рисках. Институциональная теория рисков. Современные взгляды на теорию рисков. Функции риска. Особенности проявления рисков на практике. Риск и доходность компании. Классификация рисков Дж. Кейнса. Сводная классификация рисков. Систематические и несистематические инвестиционные риски. Применение в коммуникационном процессе для ускорения передачи, обработки и интерпретации финансовой информации программные продукты Excel, Word, Outlook, Power Point, Project Expert, Miro, Zoom, Trello, 1С: ERP, Битрикс24.

Тема 2. Характеристика этапов системного анализа рисков

Система «человек – окружающая среда – опасность». Особенности формализации и моделирования опасных процессов. Определение целей системного анализа рисков. Формирование критериев. Генерирование альтернатив. Реализация выбора и принятия решений. Применение в коммуникационном процессе для ускорения передачи, обработки и интерпретации финансовой информации программные продукты Excel, Word, Outlook, Power Point, Project Expert, Miro, Zoom, Trello, 1С: ERP, Битрикс24.

Тема 3. Идентификация рисков

Концепция выявления и предварительного анализа источников риска. Методы и обобщенная процедура предварительной оценки параметров риска. Общие принципы прогнозирования риска происшествий. Причинно-следственные диаграммы. Причинно-следственные связи. Основные типы диаграмм влияния. Применение в коммуникационном процессе для ускорения передачи, обработки и интерпретации финансовой информации программные продукты Excel, Word, Outlook, Power Point, Project Expert, Miro, Zoom, Trello, 1С: ERP, Битрикс24.

Тема 4. Анализ и оценка рисков

Этапы процесса оценки рисков. Качественный подход к оценке рисков. Учет факторов риска и неопределенности непосредственно при проектировании. Учет неопределенности в виде поправок к ставке дисконта. Постулат о невозможности полного учета факторов риска и неопределенности. Методы оценки риска. Анализ рисков в условиях определенности с использованием расчетно-аналитических методов. Абсолютные и относительные показатели анализа риска. Вероятностные показатели анализа риска. Экспертные методы анализа риска. Применение в коммуникационном процессе для ускорения передачи, обработки и интерпретации финансовой информации программные продукты Excel, Word, Outlook, Power Point, Project Expert, Miro, Zoom, Trello, 1С: ERP, Битрикс24.

Тема 5. Методы системного анализа рисков

Методы качественной оценки систем. Методы типа «мозговая атака» или «коллективная генерация идей». Методы типа сценариев. Методы экспертных оценок: ранжирование; парное сравнение; множественные сравнения; непосредственная оценка; Черчмена-Акоффа; метод Терстоуна; метод фон Неймана Моргенштерна. Методы типа Дельфи: QUEST, SEER, PATTERN. Методы типа дерева целей. Морфологические методы: метод систематического покрытия поля (МСПП), метод отрицания и конструирования (МОК), метод морфологического ящика. Методы количественной оценки систем: методы теории полезности; методы векторной оптимизации; методы ситуационного управления, инженерии знаний. Применение в коммуникационном процессе для ускорения передачи, обработки и интерпретации финансовой информации программные продукты Excel, Word, Outlook, Power Point, Project Expert, Miro, Zoom, Trello, 1С: ERP, Битрикс24.

Тема 6. Управление рисками на предприятии

Альтернативные методы управления риском. Методы уклонения от риска. Локализация и диссипация риска. Методы компенсации и распределения рисков. Страхование производственных/коммерческих рисков. зарубежный опыт снижения рисков. Оценка эффективности методов управления рисками. Качественные и количественные методы оценки эффективности СУФР. Система управления рисками в рамках организации. Методы оценки и покрытия рисков в рамках концепции COSO. Методы оценки и покрытия рисков в рамках стандарта FERMA. Российский опыт покрытия рисков. Применение в коммуникационном процессе для ускорения передачи, обработки и интерпретации финансовой информации программные продукты Excel, Word, Outlook, Power Point, Project Expert, Miro, Zoom, Trello, 1С: ERP, Битрикс24.

Тема 7. Системный анализ и моделирование сложных систем

Принципы системного подхода в моделировании систем. Системность, как общее свойство окружающего мира. Определение системы. Большие и малые системы. Моделирование, как метод научного познания. Методологическая основа моделирования. Гипотезы и аналогии. Модель и моделирование. Функции модели. Модели состава и структуры системы. Классификация моделей. Исторический модельный ряд (физические, масштабные, аналоговые модели, управленческие игры, моделирование на ЭВМ, математические модели). Виды моделирования систем. Основные понятия и принципы моделирования систем. Классификация моделей. Применение в коммуникационном процессе для ускорения передачи, обработки и интерпретации финансовой информации программные продукты Excel, Word, Outlook, Power Point, Project Expert, Miro, Zoom, Trello, 1С: ERP, Битрикс24.

Тема 8. Моделирование и прогноз параметров риска

Моделирование и системный анализ происшествий с помощью диаграмм типа «дерево». Моделирование и системный анализ происшествий с помощью диаграмм типа «граф». Моделирование и системный анализ происшествий с

помощью диаграмм типа «сеть». Имитационное моделирование – метод проведения системных исследований. Методы обработки экспериментальной информации. Повышение достоверности данных за счет использования априорной информации. Применение в коммуникационном процессе для ускорения передачи, обработки и интерпретации финансовой информации программные продукты Excel, Word, Outlook, Power Point, Project Expert, Miro, Zoom, Trello, 1С: ERP, Битрикс24.

4.3 Лекции/практические занятия

Таблица 4

Содержание лекций/практических занятий и контрольные мероприятия

| № п/п | № раздела | № и название лекций/практических занятий | Формируемые компетенции | Вид контрольного мероприятия | Кол-во часов/* |
|-------|------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|----------------|
| 1. | Тема 1 Понятие и сущность риска | Лекция №1 Понятие и сущность риска | ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3 | | 2 |
| | | Практическая работа №1 Понятие и сущность риска | ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3 | устный опрос, тестирование | 6/2 |
| 2. | Тема 2. Характеристика этапов системного анализа рисков | Лекция №2 Характеристика этапов системного анализа рисков | ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3 | | 2 |
| | | Практическая работа №2 Характеристика этапов системного анализа рисков | ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3 | устный опрос, ситуационные задания | 6/2 |
| 3. | Тема 3. Идентификация рисков | Лекция №3 Идентификация рисков | ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3 | Интерактивная лекция | 2/2 |
| | | Практическая работа №3 Идентификация рисков | ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3 | устный опрос, ситуационные задания | 6/2 |

| № п/п | № раздела | № и название лекций/ практических занятий | Формируемые компетенции | Вид контрольного мероприятия | Кол-во часов/* |
|-------|-----------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|----------------|
| | Тема 4. Анализ и оценка рисков | Лекция №4 Анализ и оценка рисков | ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3 | Интерактивная лекция | 2/2 |
| | | Практическая работа №4 Анализ и оценка рисков | ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3 | устный опрос, ситуационные задания | 6/2 |
| 5. | Тема 5. Методы системного анализа рисков | Лекция №5 Методы системного анализа рисков | ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3 | Интерактивная лекция | 2/2 |
| | | Практическая работа №5 Методы системного анализа рисков | ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3 | устный опрос, ситуационные задания | 8/2 |
| 6. | Тема 6. Управление рисками на предприятии | Лекция №6 Управление рисками на предприятии | ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3 | Интерактивная лекция | 2/2 |
| | | Практическая работа №6 Управление рисками на предприятии | ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3 | устный опрос, тестирование | 6/2 |
| 7. | Тема 7 Системный анализ и моделирования сложных систем | Лекция №7 Системный анализ и моделирования сложных систем | УК-6.1; УК-6.2; УК-6.3; ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-5.1; Пкос-5.2; Пкос-5.3 | Интерактивная лекция | 8/4 |
| | | Практическая работа №7 Системный анализ и моделирования сложных систем | ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; | устный опрос, ситуационные задания | 6/2 |

| № п/п | № раздела | № и название лекций/ практических занятий | Формируемые компетенции | Вид контрольного мероприятия | Кол-во часов/* |
|-------|--------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|----------------|
| | | | ПКос-2.3 | | |
| 8. | Тема 8. Моделирование и прогноз параметров риска | Лекция №8 Моделирование и прогноз параметров риска | ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3 | Интерактивная лекция | 2/2 |
| | | Практическая работа №8 Моделирование и прогноз параметров риска | ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3 | устный опрос, ситуационные задания | 6/2 |

* в том числе практическая подготовка

Таблица 5

Перечень вопросов для самостоятельного изучения дисциплины

| № п/п | № раздела темы | Перечень рассматриваемых вопросов для самостоятельного изучения |
|-------|--------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. | Тема 1 Понятие и сущность риска | История возникновения теории рисков и ее развитие. (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.) |
| 2. | Тема 2 Характеристика этапов системного анализа рисков | Особенности формализации и моделирования опасных процессов (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.) . |
| 3. | Тема 3 Идентификация рисков | Методы и обобщенная процедура предварительной оценки параметров риска (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.) |
| 4. | Тема 4 Анализ и оценка рисков | Абсолютные и относительные показатели анализа риска (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.) |
| 5. | Тема 5 Методы системного анализа рисков | Морфологические методы: метод систематического покрытия поля (МСПП), метод отрицания и конструирования (МОК), метод морфологического ящика (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.) |
| 6. | Тема 6 Управление рисками на предприятии | Методы оценки и покрытия рисков в рамках концепции COSO (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.) |
| 7. | Тема 7 Системный анализ и моделирования сложных систем | Системность, как общее свойство окружающего мира. ((ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)) |
| 8. | Тема 8. Моделирование и прогноз параметров риска | Методы обработки экспериментальной информации (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.) . |

5. Образовательные технологии

Таблица 6

Применение активных и интерактивных образовательных технологий

| № п/п | Тема и форма занятия | | Наименование используемых активных и интерактивных образовательных технологий |
|-------|--------------------------------------------------------|----|-------------------------------------------------------------------------------|
| 1 | Тема 1 Понятие и сущность риска | ПЗ | Технология активного обучения (ситуационные задания) |
| 2 | Тема 2 Характеристика этапов системного анализа рисков | ПЗ | Технология активного обучения (ситуационные задания) |
| 3 | Тема 3 Идентификация рисков | ПЗ | Технология активного обучения (ситуационные задания) |
| 4 | Тема 4 Анализ и оценка рисков | ПЗ | Технология активного обучения (ситуационные задания) |
| 5 | Тема 5 Методы системного анализа рисков | ПЗ | Технология активного обучения (ситуационные задания) |
| 6 | Тема 6 Управление рисками на предприятии | ПЗ | Технология активного обучения (ситуационные задания) |
| 7 | Тема 7 Системный анализ и моделирования сложных систем | ПЗ | Технология активного обучения (ситуационные задания) |
| 8 | Тема 8. Моделирование и прогноз параметров риска | ПЗ | Технология активного обучения (ситуационные задания) |

6. Текущий контроль успеваемости и промежуточная аттестация по итогам освоения дисциплины

6.1. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений и навыков и (или) опыта деятельности деятельности

Типовые тесты

По теме 1. Понятие и сущность риска

1. Возможность опасности, неудачи, по С.И. Ожегову, это:

- А – невезение;
- Б – риск;
- В – кризис;
- Г – угроза.

2. В работе какого из представленных экономистов впервые была высказана мысль о риске, как о количественной мере неопределенности?

- А – Ф. Найт;
- Б. - О. Моргенштерн;
- В – Дж. Нейман;
- Г – Дж. М. Кейнс.

3. Что из перечисленного НЕ относится к основным чертам риска?

- А – неопределенность;
- Б – альтернативность;
- В – перспективность;
- Г – противоречивость.

4. Какое свойство НЕ относится к общим, определяющим понятие и проявления риска?

- А – риск является многомерной характеристикой будущих состояний
- Б – риск связан со случайными явлениями и процессами;
- В – последствия рискованных действий всегда носят отрицательный
- Г – проявление риска – условное событие.

5. Какой концепции риска НЕ существует?

- А – риск как опасность или угроза;
- Б – риск как неопределенность;
- В – риск как возможность;
- Г – риск как худшая альтернатива.

6. Укажите определение риска в рамках концепции неопределенности:

- А – возможность наступления событий с негативными последствиями;
- Б – мера несоответствия между различными результатами решений, которые оценивают с точки зрения их полезности, вредности, а также эффективности по критериям соответствия выбранным ориентирам;
- В – неопределенность в отношении возможных потерь на пути к цели;
- Г – действие наудачу в надежде на счастливый случай.

7. Что НЕ относится к объектам исследования в теории рисков и безопасности?

- А – источники опасности и неопределенности;
- Б – объекты риска или безопасности;
- В – субъекты обеспечения безопасности;
- Г – связи между источниками опасности и объектами безопасности;
- Д – последствия наступления рискованной ситуации;
- Е – системы защиты объектов риска, создаваемые субъектами обеспечения безопасности.

8. К какой группе объектов исследований в теории рисков и безопасности относится государство?

- А – источник опасности и неопределенности;
- Б – объект риска или безопасности;
- В – субъект обеспечения безопасности;
- Г – система защиты объектов риска;
- Д – верны ответы А и В;
- Е – верны ответы Б и В.

9. Какой системы защиты объектов рисков НЕ существует?

- А – личная безопасность;
- Б – частная безопасность;
- В – коллективная безопасность;
- Г – глобальная безопасность.

10. Состояние материально – вещественной и стоимостной структуры производства и реализации продукции и такая ее динамика, при которой

обеспечивается стабильно высокий результат функционирования предприятия, это:

А – устойчивость предприятия;

Б – рентабельность предприятия;

В – эффективность деятельности предприятия;

Г – динамика предприятия.

Контрольные вопросы текущего контроля по дисциплине «Системный анализ рисков»

1. В чем заключается сущность риска?
2. Какие понятия риска, предлагаемые различными авторами, вы знаете?
3. В чем сходства этих понятий, а в чем различия?
4. Укажите основные моменты, характерные для рисковой ситуации. Как вы считаете, для возникновения рисковой ситуации необходимо наличие всех перечисленных моментов?
5. Какие элементы отражают сущность риска?
6. Укажите основные черты риска. Охарактеризуйте их и приведите примеры.
7. Какие точки зрения на природу риска Вы знаете?
8. Какая из точек зрения в настоящее время является преобладающей?
9. Какие концепции риска в настоящее время используются на практике?
10. Перечислите объекты исследования в теории рисков и безопасности. Как вы понимаете взаимосвязь между ними?
11. Какие объекты исследования в теории рисков и безопасности относятся к источникам опасности? Объектам рисков/безопасности?
12. Субъектам обеспечения безопасности? Какие существуют связи между источниками опасности и объектами безопасности? Приведите примеры
13. Что такое устойчивость предприятия и устойчивость среды? Укажите их основные характеристики.
14. Какие виды устойчивости внутренней среды Вы знаете? Как взаимосвязаны основные типы устойчивости предприятия и факторы риска?
15. Что такое классификация? Зачем необходимо классифицировать риски?
16. Какие классификации рисков существуют? В чем их существенные сходства и различия?
17. Перечислите основные принципы классификации рисков.
18. Какие риски являются чистыми? Перечислите их. В каких ситуациях они появляются?
19. Какие риски являются спекулятивными? В чем заключаются существенные отличия спекулятивных рисков от чистых?
20. Укажите виды рисков, в зависимости от основной причины их возникновения.
21. Укажите виды рисков по сфере их возникновения.

22. Какие риски должен учитывать менеджер при осуществлении предпринимательской деятельности?
23. Приведите пример систематических и специфических рисков для конкретного предприятия.
24. С какими видами рисков предпринимательской деятельности менеджер может успешно бороться?
25. Дайте понятие неопределенности. Укажите основные причины возникновения неопределенности. В каких условиях неопределенность степень может быть снижена?
26. Какие формы неопределенности Вам известны? Приведите примеры.
27. Что может являться результатом проявления неопределенности? Всегда ли результат проявления неопределенности будет отрицательным? Приведите различные примеры положительного результата проявления неопределенности.
28. Всегда ли неопределенность приводит к риску? От чего может зависеть результат деятельности, совершаемой в условиях неопределенности?
29. Что относят к основным причинам неопределенности?
30. Опишите варианты учета и использования существующей неопределенности.
31. Какие виды неопределенности Вам известны? Перечислите варианты учета и использования существующей неопределенности в зависимости от важности исследуемой области.
32. Для чего необходимо классифицировать неопределенность? Каким образом необходимо бороться с различными видами неопределенности?
33. Соотнесите между собой понятие неопределенности и риска. Какую роль в предпринимательской деятельности играет неопределенность? Какую роль играет риск?
34. Опишите различные точки зрения на соотношение понятий неопределенности и риска между собой.
35. Что такое зоны предпринимательского риска? Зачем необходимо определять зоны предпринимательского риска? В какой зоне предпринимательского риска возможны минимальные потери? А максимальные?
36. Что представляет собой ситуация полной определенности? При каких условиях возможна такая ситуация? Какие методы анализа и оценки риска применяются в условиях полной определенности?
37. Что применяется в качестве абсолютных показателей оценки риска? Что такое относительные показатели оценки риска? Перечислите средние показатели оценки риска.
38. Влияет ли ситуация полной определенности на принимаемое решение о дальнейших действиях? Каким образом? В каком случае ситуация полной определенности может стать ситуацией частичной неопределенности?
39. Что представляет собой ситуация частичной неопределенности? При каких условиях возможна такая ситуация? Какие методы анализа и оценки риска применяются в условиях частичной неопределенности?
40. Какие вероятностные и статистические показатели применяются для оценки риска в условиях частичной неопределенности? В чем их различия?

41. Каким образом ситуация частичной неопределенности влияет на принимаемое решение о дальнейших действиях? В каком случае ситуация частичной неопределенности может стать ситуацией полной неопределенности?

42. Что представляет собой ситуация полной неопределенности? При каких условиях возможна такая ситуация? Какие методы анализа и оценки риска применяются в условиях полной неопределенности?

43. В чем заключается сущность экспертных методов оценки риска? Какие основные критерии выбора рискованных решений вам известны? Перечислите основные аналитические методы принятия решений в условиях риска.

44. Каким образом ситуация полной неопределенности влияет на принимаемое решение о дальнейших действиях? В каком случае ситуация полной неопределенности может стать ситуацией полной определенности?

45. Какие факторы влияют на выбор приемов управления риском? Кто принимает решение о применении того или иного метода снижения риска?

46. Какие методы снижения риска Вы знаете? Укажите их основные достоинства и недостатки. Приведите примеры применения методов снижения риска для человека, семьи, предприятия.

47. В чем заключается сущность избежания риска? В каких случаях целесообразно применять данный метод?

48. Охарактеризуйте основные приемы избежания риска. В каких случаях их целесообразно применять?

49. В чем заключается сущность принятия риска? Какими ресурсами необходимо обладать предприятию для осуществления метода принятия риска? Какие ограничения по отношению к ресурсам необходимо учитывать в случае их использования предприятием?

50. Охарактеризуйте основные приемы принятия риска. В каких случаях их целесообразно применять?

51. В чем заключается сущность смягчения риска? Дайте определение понятия страхование. Чем страхование отличается от самострахования?

52. Охарактеризуйте основные приемы смягчения риска. В каких случаях их целесообразно применять?

53. В чем заключается сущность передачи риска? Всегда ли передача риска будет эффективным методом?

54. В чем заключается сущность диверсификации риска? Каким образом можно диверсифицировать риск? Что такое проект? В чем заключается сущность проектной деятельности? Чем проектная деятельность отличается от операционной? В чем проявляются их сходства?

55. Укажите основные виды проектных рисков. Приведите примеры по каждому представленному виду риска. Может ли в процессе работы над проектом существовать одновременно несколько видов риска?

56. Укажите виды рисков, которые характерны как для проектной, так и операционной деятельности предприятия. Какие виды специфичны только для проектов?

57. В чем заключается сущность алгоритма управления проектными рисками. Для разработки каких проектов необходимо его применять? В каких случаях данный алгоритм необходимо модернизировать?

58. Перечислите основные этапы управления проектными рисками. В чем заключается сущность этапа разработки мероприятий по снижению уровня риска? Почему в рамках алгоритма отдельно выделен этап принятия риска?

59. От каких критериев зависит оценка эффективности применения того или иного метода управления проектными рисками? На каком этапе управления проектами необходимо оценивать эффективность мероприятий по снижению рисков?

60. Перечислите основные группы методик идентификации, оценки и прогноза рисков в зависимости от используемой исходной информации. В каких случаях применяются различные методики.

61. В чем заключается разница между статистическими, вероятностно-статистическими и теоретико-статистическими методиками? Приведите примеры.

62. Дайте определение планирования управления проектными рисками. Какие документы необходимы для разработки плана управления рисками? Кто может принимать участие в совещании для разработки плана по управлению рисками?

63. 1Какие мероприятия необходимо реализовать руководству организации для создания эффективной системы управления проектными рисками? Будут ли принятые мероприятия в рамках одного проекта аналогично действовать для другого проекта в рамках одной организации?

64. Какие специфические виды риска присущи различным областям народного хозяйства? Приведите примеры рисков, которые могут возникнуть у любого предприятия, вне зависимости от его сферы деятельности.

65. Почему каждому предприятию необходимо разрабатывать собственную стратегию по минимизации рисков? Как данная стратегия должна учитывать сильные и слабые стороны предприятия? Внешние возможности и угрозы?

66. В чем заключаются особенности риск-менеджмента для различных видов деятельности? Почему необходимо разрабатывать собственные механизмы по управлению рисками в зависимости от вида деятельности?

67. Охарактеризуйте особенности управление рисками в банковском бизнесе. Какие виды рисков относятся непосредственно к банковским, а какие к общим? Опишите основные меры по управлению банковскими рисками. Что такое кредитный скоринг? Каким образом он используется для минимизации рисков?

68. В чем заключаются риски предприятий в сфере сервиса? Какие факторы гостиничной индустрии способствуют повышению степени риска? Перечислите проблемы, существующие в российском гостиничном хозяйстве, которые оказывают непосредственное влияние на возникновение рисков.

69. Опишите особенности риск-менеджмента в страховании. Каким рискам больше всего подвержены страховые компании? Какие показатели необходимо учитывать страховым компаниям в процессе анализа риск-менеджмента?

70. Риск-менеджмент туризма: особенности управления рисками в туристской отрасли. Почему туризм считается достаточно рискованным видом предпринимательской деятельности? Охарактеризуйте основные риски в сфере туризма.

71. Риск-менеджмент промышленных предприятий. Какие виды рисков характерны для промышленных предприятий в целом, в зависимости от отрасли деятельности?

72. Особенности риск-менеджмента в сфере агропромышленного производства. Перечислите основные особенности агропромышленного производства. Какие методы минимизации рисков в аграрном секторе вам известны?

73. Можно ли применять полученный опыт по управлению рисками в одной сфере деятельности для совершенно иной сферы деятельности? Какие методы могут быть общими, а какие – специфическими?

74. В чем заключается сущность принятия решений в условиях риска? Что является целью разработки модели управления риском на предприятии?

75. Укажите основные этапы принятия управленческих решений в условиях неопределенности. Что подразумевается под принятием решения? Каким образом можно повысить результативность принятия решения в условиях неопределенности?

76. Какие цели и задачи по управлению риском ставятся перед лицом, принимающим управленческие решения?

77. Для чего необходима классификация и идентификация рисков в рамках принятия управленческих решений? Каким образом могут отличаться решения, принимаемые в отношении чистых и спекулятивных рисков?

78. Какие моменты необходимо учитывать при принятии управленческого решения в условиях полной определенности? Частичной неопределенности? Полной неопределенности?

79. Каковы требования к лицу, принимающему решения в условиях риска? Что является главной задачей любого руководителя вне зависимости от его иерархического уровня и объекта управления?

80. Укажите личностные факторы, влияющие на степень риска при принятии управленческих решений. Какие факторы являются врожденными, а какие необходимо приобретать?

Типовые ситуационные задания по практике дисциплины «Системный анализ рисков»

Теория управления рисками предполагает целостную систему знаний, которую характеризуют логическая зависимость и взаимосвязи между доходом и финансовой устойчивостью в определенных границах риска для достижения разнообразных целей субъектом предпринимательской деятельности.

Теория управления рисками учитывает следующее:

1) при открытой рыночной экономике иерархическая граница между макро-, мезо- и микроуровнями практически «стирается» по причине общности и связанности интересов продавцов и покупателей на рынках товаров и услуг, рабочей силы и ценных бумаг, организованных форм производства и международного разделения труда и другим;

2) общее экономическое равновесие большой системы зависит от трех классов риска – экономического, социально-политического и фискально-

монетарного, которые взаимодействуют одновременно на всех уровнях экономики с различной степенью и зависимостью;

3) экономическая надежность функционирования производственной системы зависит от взаимосвязей между величиной риска, доходностью и производственно-финансовой устойчивостью субъекта предпринимательской деятельности. С изменением степени риска доходность возрастает или уменьшается в процентном отношении к риску и к хозяйственно-финансовой устойчивости;

4) областью допустимых значений доходности и производственно хозяйственной устойчивости является доверительный интервал риска с определенными граничными значениями. Минимальное его значение – безрисковые государственные ценные бумаги, максимальное – вероятность наступления банкротства проекта;

5) изменения основных показателей доходности макро-, мезо- и микро-уровней прежде всего зависят от возможности субъекта предпринимательской деятельности эффективно управлять риском.

Теория управления рисками предполагает рассмотрение общих принципов и закономерностей экономического развития большой системы при условии, что государство вмешивается в экономику только с целью минимизации негативных последствий на рынке.

Любая рыночная экономика опирается на три фундаментальных принципа:

- экономическую свободу;
- экономические отношения;
- частную собственность.

В целях классификации рисков и выбора единых принципов по их формированию можно выделить три основные класса рисков – экономический, социально-политический и фискально-монетарный.

Под экономическим риском понимается совокупность неопределенностей, возникающих в развитии большой системы в целом и ее составляющих, в том числе, если ставится цель по установлению общеэкономического равновесия такой системы и темпов роста ее внутреннего валового продукта (ВВП) через выпуск конкурентоспособной продукции на мировом рынке, выбор рационального сочетания форм производства, осуществление эффективных мероприятий с использованием государственных антициклических методов и механизмов и другого. Фискально-монетарный риск представляет собой совокупность неопределенностей, возникающих при решении задач по обеспечению экономического роста и стабильности больших, сложных систем с помощью проводимой государством финансовой и бюджетной политики, через механизмы стабилизации уровня цен и оптимальные налоговые нормы, эффективного вмешательства Центрального банка по регулированию конъюнктуры и обеспечению денежной массы и другого.

Под социально-политическим риском понимается совокупность неопределенностей, возникающих в развитии большой системы в целом и ее составляющих, в том числе при вмешательстве государства в политику ценообразова-

ния, а также в решение задач по мобилизации и концентрации источников накопления имущественных и интеллектуальных ценностей для:

- обеспечения социальной защиты всех групп населения от жизненных рисков общего характера;

- справедливого распределения доходов;

- сокращения безработицы;

- регулирования объемов предложения или спроса через цену.

К таким рискам относятся юридические и правовые факторы.

Задание.

Подготовьте ответы на приведенные ниже вопросы:

1. Что входит в понятие «теория управления рисками»?

2. На каких основах базируется теория управления рисками?

3. В чем принципиальная разница между экономическим, фискально-монетарным и социально-политическим рисками?

Перечень вопросов, выносимых на промежуточную аттестацию (зачет с оценкой)

1. Понятия "риск" и "неопределенность" (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
2. Противоречивость и альтернативность риска (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
3. Источники риска (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
4. История возникновения теории рисков и ее развитие (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
5. Маржиналистическая теория и марксистское учение о рисках. Институциональная теория рисков (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
6. Современные взгляды на теорию риска (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
7. Функции риска (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
8. Особенности проявления рисков на практик (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
9. Риск и доходность компании (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
10. Классификация рисков Дж. Кейнс (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
11. Сводная классификация рисков (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
12. Систематические и несистематические инвестиционные риски (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
13. Система «человек – окружающая среда – опасность» (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)

14. Особенности формализации и моделирования опасных процессов(ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
15. Определение целей системного анализа риска(ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
16. Формирование критерие (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
17. Генерирование альтернатив (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
18. Реализация выбора и принятия решени(ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
19. Концепция выявления и предварительного (качественного) анализа источников риска (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
20. Методы и обобщенная процедура предварительной оценки параметров риска (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
21. Общие принципы прогнозирования риска происшествия (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
22. Причинно-следственные диаграмм(ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
23. Причинно-следственные связи (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
24. Основные типы диаграмм влияния
25. (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
26. Этапы процесса оценки рисков (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
27. Качественный подход к оценке рисков (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
28. Учет факторов риска и неопределенности непосредственно при проектировании (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
29. Учет неопределенности в виде поправок к ставке дисконта (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
30. Постулат о невозможности полного учета факторов риска и неопределенности (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
31. Методы оценки риска(ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
32. Анализ рисков в условиях определенности с использованием расчетно-аналитических методов (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
33. Абсолютные и относительные показатели анализа риска. Вероятностные показатели анализа риска (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
34. Экспертные методы анализа риска (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
35. Методы качественной оценки систем (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)
36. Методы типа «мозговая атака» или «коллективная генерация идей» (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; Пкос-2.1; Пкос-2.2; Пкос-2.3.)

37. Методы типа сценариев (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
38. Методы экспертных оценок: ранжирование; парное сравнение; множественные сравнения; непосредственная оценка; Черчмена-Акоффа; метод Терстоуна; метод фон Неймана Моргенштерна (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
39. Методы типа Дельфи: QUEST, SEER, PATTERN (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
40. Методы типа дерева целей (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
41. Морфологические методы: метод систематического покрытия поля (МСПП), метод отрицания и конструирования (МОК), метод морфологического ящика (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
42. Методы количественной оценки систем: методы теории полезности; методы векторной оптимизации; методы ситуационного управления, инженерии знаний (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
43. Альтернативные методы управления риском (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
44. Методы уклонения от риска (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
45. Локализация и диссипация риска (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
46. Методы компенсации и распределения рисков (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
47. Страхование производственных/коммерческих рисков (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
48. Зарубежный опыт снижения рисков (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
49. Оценка эффективности методов управления рисками (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
50. Качественные и количественные методы оценки эффективности СУФР (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
51. Система управления рисками в рамках организации (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
52. Методы оценки и покрытия рисков в рамках концепции COSO (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
53. Методы оценки и покрытия рисков в рамках стандарта FERMA (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
54. Российский опыт покрытия рисков (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
55. Принципы системного подхода в моделировании систем (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
56. Системность, как общее свойство окружающего мира. Определение системы (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
57. Большие и малые системы (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)

58. Моделирование, как метод научного познания (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
59. Методологическая основа моделирования (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
60. Гипотезы и аналогии (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
61. Модель и моделирование (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
62. Функции модели (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
63. Модели состава и структуры системы (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
64. Классификация моделей (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
65. Исторический модельный ряд (физические, масштабные, аналоговые модели, управленческие игры, моделирование на ЭВМ, математические модели) (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
66. Виды моделирования систем (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
67. Основные понятия и принципы моделирования систем (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
68. Классификация моделей (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
69. Моделирование и системный анализ происшествий с помощью диаграмм типа «дерево» (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
70. Моделирование и системный анализ происшествий с помощью диаграмм типа «граф» (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
71. Моделирование и системный анализ происшествий с помощью диаграмм типа «сеть» (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
72. Имитационное моделирование – метод проведения системных исследований (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
73. Методы обработки экспериментальной информации (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
74. Повышение достоверности данных за счет использования априорной информации (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
75. Работа с Трудовым кодексом РФ на платформе Гарант (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
76. Электронные ресурсы (Яндекс, Mail, Бизнес-навигатор МСП) (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
77. Информационное обеспечение системного анализа рисков (Проведение совещаний при помощи Zoom, обмен информацией посредством системы Google –документов, Outlook, Power Point) (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)
78. Способы анализа рисков (1С, Statistica, Project Expert, TABLEAU) (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)

79. Применение в коммуникационном процессе для ускорения передачи, обработки и интерпретации информации программные продукты Excel, Word, Outlook, Power Point, Project Expert, Miro, Zoom, Trello, 1С: ERP, Битрикс24 (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3.)

80. Инструменты моделирования и оптимизации решений Project Expert, TABLEAU, Power Point для формирования объективного акта ревизии (ПКос-1.1; ПКос-1.2; ПКос-1.3; ПКос-2.1; ПКос-2.2; ПКос-2.3)

6.2. Описание показателей и критериев контроля успеваемости, описание шкал оценивания

Для оценки знаний, умений, навыков и формирования компетенции по дисциплине применяется балльно-рейтинговая система контроля и оценки успеваемости студентов (табл. 7). Максимальное количество баллов по текущему контролю – 108 баллов.

Таблица 7

| Шкала оценивания | Оценка |
|------------------|---------------------|
| 92-108 | Отлично |
| 77-91 | Хорошо |
| 65-76 | Удовлетворительно |
| 0-64 | Неудовлетворительно |

В основу балльно-рейтинговой системы (БРС) положены принципы, в соответствии с которыми формирование рейтинга студента осуществляется в ходе текущего, промежуточного контроля и промежуточной аттестации знаний. При общей сумме баллов по результатам текущего контроля менее 65 баллов (табл. 8), студенту выставляется оценка «неудовлетворительно».

Ликвидация студентами текущей задолженности осуществляется путем предоставления конспектов по темам лекций и практических занятий по курсу. Студенту может быть выставлена итоговая оценка по дисциплине на основе набранных баллов по текущему контролю, если студент набрал свыше 64 баллов, если студент не претендует на более высокую оценку. Если он претендует на более высокую оценку, то он отвечает на два вопроса из перечня вопросов к зачету с оценкой. Каждый вопрос оценивается по 10 балльной шкале.

Таблица 8

Диапазоны итоговой оценки текущего контроля в 6 семестре

| БРС | Итоговая оценка |
|----------------------|-----------------|
| Устный опрос | 0-40 |
| Ситуационные задания | 0-77 |
| Тесты | 0-13 |
| Итого | 0-108 |

Максимальное количество по промежуточной аттестации – 20

Общее количество баллов для оценки промежуточного контроля

| Максимальная сумма баллов | Зачет с оценкой | | | |
|---------------------------|---------------------|-------------------|--------|---------|
| | Неудовлетворительно | Удовлетворительно | Хорошо | Отлично |
| 20 | 0-11 | 12-14 | 15-17 | 18-20 |

Если по результатам промежуточного контроля студент набирает менее 5 баллов, ему выставляется оценка «неудовлетворительно». Передача экзамена осуществляется в соответствии с Положением о промежуточной аттестации студентов в Университете.

Таблица 10

Критерии оценивания результатов обучения

| Оценка | Критерии оценивания |
|-------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Высокий уровень «5» (отлично) | оценку « отлично » заслуживает студент, освоивший знания, умения, компетенции и теоретический материал без пробелов; выполнивший все задания, предусмотренные учебным планом на высоком качественном уровне; практические навыки профессионального применения освоенных знаний сформированы; демонстрирует возможности интернет-ресурсов и программных продуктов при решении профессиональных задач (Консультант, Гарант, официальные сайты министерств и ведомств, Nalog.ru, CRM, ERP системы, Бизнес-навигатор МСП); владеет навыками поиска информации посредством электронных ресурсов (Яндекс, Mail), официальных сайтов различных ведомств; навыками расчёта влияния различных факторов на размер прибыли, используя программу Statistica, осуществлять расчет показателей экономической эффективности проекта с использованием программных продуктов Project Expert, Бизнес-конструктор, Бизнес-навигатор МСП, осуществлять обмен информацией при осуществлении финансовых проверок с применением системы Google, Miro с целью принятия экономически обоснованных управленческих решений при осуществлении ревизии, владения навыками распределения задач в системе Битрикс24, навыками визуализации данных в процессе ревизии с применением TABLEAU; умения применять в коммуникационном процессе для ускорения процесса передачи, обработки и интерпретации финансовой информации такие программные продукты, как Excel, Word, Outlook, Power Point, Project Expert, Miro, Zoom, Trello, 1 С: ERP. Компетенции, закреплённые за дисциплиной, сформированы на уровне – высокий. |
| Средний уровень «4» (хорошо) | оценку « хорошо » заслуживает студент, практически полностью освоивший знания, умения, компетенции и теоретический материал, учебные задания не оценены максимальным числом баллов, в основном сформировал практические навыки; демонстрирует возможности интернет-ресурсов и программных продуктов при решении профессиональных задач (Консультант, Гарант, официальные сайты министерств и ведомств, Nalog.ru, CRM, ERP системы, Бизнес-навигатор МСП); владеет навыками поиска информации посредством электронных ресурсов (Яндекс, Mail), официальных сайтов различных ведомств; навыками расчёта влияния различных факторов на размер прибыли, используя программу Statistica, осуществлять расчет показателей экономической эффективности проекта с использованием программных продуктов Project Expert, Бизнес-конструктор, |

| | |
|-----------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | Бизнес-навигатор МСП, осуществлять обмен информацией при осуществлении финансовых проверок с применением системы Google, Miro с целью принятия экономически обоснованных управленческих решений при осуществлении ревизии, владения навыками распределения задач в системе Битрикс24, навыками визуализации данных в процессе ревизии с применением TABLEAU. Компетенции , закреплённые за дисциплиной, сформированы на уровне – хороший (средний) . |
| Пороговый уровень «3» (удовлетворительно) | оценку «удовлетворительно» заслуживает студент, частично с пробелами освоивший знания, умения, компетенции и теоретический материал, многие учебные задания либо не выполнил, либо они оценены числом баллов близким к минимальному, некоторые практические навыки не сформированы; демонстрирует возможности интернет-ресурсов и программных продуктов при решении профессиональных задач (Консультант, Гарант, официальные сайты министерств и ведомств, Nalog.ru, CRM, ERP системы, Бизнес-навигатор МСП); владеет навыками поиска информации посредством электронных ресурсов (Яндекс, Mail), официальных сайтов различных ведомств. Компетенции , закреплённые за дисциплиной, сформированы на уровне – достаточный . |
| Минимальный уровень «2» (неудовлетворительно) | оценку «неудовлетворительно» заслуживает студент, не освоивший знания, умения, компетенции и теоретический материал, учебные задания не выполнил, практические навыки не сформированы; студент не владеет возможностями интернет-ресурсов и программных продуктов при решении профессиональных задач (Консультант, Гарант, официальные сайты министерств и ведомств, Nalog.ru, CRM, ERP системы, Бизнес-навигатор МСП); не владеет навыками поиска информации посредством электронных ресурсов (Яндекс, Mail), официальных сайтов различных ведомств; не имеет навыков расчёта влияния различных факторов на размер прибыли, используя программу Statistica, не владеет навыками распределения задач в системе Битрикс24, не владеет навыками визуализации данных в процессе ревизии с применением TABLEAU; не умеет применять в коммуникационном процессе для ускорения процесса передачи, обработки и интерпретации финансовой информации такие программные продукты, как Excel, Word, Outlook, Power Point, Project Expert, Miro, Zoom, Trello, 1 С: ERP. Компетенции , закреплённые за дисциплиной, не сформированы . |

7. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

7 1. Основная литература

1. Белов, П. Г. Системный анализ и программно-целевой менеджмент рисков : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 289 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-04690-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/493057> (дата обращения: 29.09.2022).

2. Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 1, 2, 3 : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 250 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-

534-02608-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/490635> (дата обращения: 29.09.2022).

7.2 Дополнительная литература

1. Зарук, Н.Ф. Финансовый менеджмент: учебное пособие/ Н.Ф. Зарук, Р.В. Костина, М.Е. Уртянова// Москва: РГАУ-МСХА им. К. А. Тимирязева, 2018.
2. Зарук, Н.Ф. Страхование и хеджирование рисков: учебное пособие/ Н.Ф. Зарук, О.В. Синельникова// Москва: Росинформагротех, 2017.
3. Северцев, Н. А. Системный анализ теории безопасности : учебное пособие для вузов / Н. А. Северцев, А. В. Бецков. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 456 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-07985-2. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/493334> (дата обращения: 29.09.2022).

7.3 Нормативные правовые акты

Конституция Российской Федерации, 1993 г. (с учетом поправок, внесенных Законами Российской Федерации о поправках к Конституции Российской Федерации от 30.12.2008 №6-ФКЗ, от 30.12.2008 №7-ФКЗ, от 05.02.2014, от 21.07.2014 №11-ФКЗ).

2. Уголовно-процессуальный кодекс Российской Федерации от 18.12.2001 №174-ФЗ.
3. Арбитражный процессуальный кодекс Российской Федерации от 24.07.2002 №95-ФЗ.
4. Кодекс Российской Федерации об административных правонарушениях, от 30 декабря 2001 г. №195-ФЗ.
5. Налоговый кодекс Российской Федерации. Часть первая от 31.10.1998 г №146-ФЗ (ред. от 29.12.2015) и часть 2 от 05.08.2000 №117-ФЗ (ред. от 29.12.2015).
6. Гражданский кодекс РФ. часть первая от 30 ноября 1994 г. №51-ФЗ, часть вторая от 26 января 1996 г. №14-ФЗ, часть третья от 26 ноября 2001 г. №146-ФЗ и часть четвертая от 18 декабря 2006 г. №230-ФЗ.
7. Федеральный закон от 7 февраля 2011 г. №3-ФЗ «О полиции» (в ред. от 21.07.2014 г.).
8. Федеральный закон «О бухгалтерском учете» от 06 декабря 2011 г. №402-ФЗ (в ред. от 28.12.2013 г.).
9. Федеральный закон от 12 августа 1995 №144-ФЗ «Об оперативно-розыскной деятельности» (в ред. от 21.12.2013 г.).
10. Федеральный закон от 26 декабря 1995 №208-ФЗ «Об акционерных обществах» (в ред. от 21.07.2014 г.).

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

1. . Правительство Российской Федерации. – Открытый доступ. – Режим доступа к материалам: <http://government.ru>.

2. Министерство сельского хозяйства Российской Федерации. – Открытый доступ. – Режим доступа к материалам: <http://mcsx.ru>
3. Министерство экономического развития Российской Федерации. – Открытый доступ. – Режим доступа к материалам: <http://economy.gov.ru>.
4. Федеральная служба безопасности РФ. – Открытый доступ. – Режим доступа к материалам: <http://fsb.ru>.
5. Министерство внутренних дел Российской Федерации. – Открытый доступ. – Режим доступа к материалам: <http://мвд.рф>.
6. Электронная библиотека бесплатных электронных книг по бизнесу, финансам, экономике и смежным темам. – Открытый доступ. – Режим доступа к материалам: <http://www.finbook.biz>.
7. Библиотека экономической и управленческой литературы. – Открытый доступ. – Режим доступа к материалам: <http://eur.ru>.
8. Библиотека экономических журналов на английском языке. – Открытый доступ. – Режим доступа к материалам: <http://www.oswego.edu/~economic/journals.htm>

9. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

Для освоения дисциплины рекомендуются следующие сайты информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:

- официальный сайт университета: <https://www.timacad.ru/>
- Федеральная служба государственной статистики. – Режим доступа: <http://www.gks.ru>
- Битрикс24. Официальный сайт. Режим доступа: <https://www.bitrix24.ru/whatisthis/> – <https://www.tableau.com/products>
- Бизнес-портал Бизнес-навигатор МСП. Электронный ресурс. Режим доступа <https://smbn.ru/>
- Справочная правовая система «КонсультантПлюс» Режим доступа www.consultant.ru
- Справочная правовая система «Гарант» Режим доступа www.garant.ru

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

Лекционные занятия проводятся в аудиториях, оборудованных мультимедийными средствами.

Особых требований к мультимедийному оборудованию нет.

Требований к программному обеспечению учебного процесса дисциплины «Системный анализ рисков»: Google-документы, Zoom, Miro, Яндекс, Mail, Битрикс24.

**Сведения об обеспеченности специализированными аудиториями,
кабинетами, лабораториями**

| Наименование специальных помещений и помещений для самостоятельной работы (№ учебного корпуса, № аудитории) | Оснащенность специальных помещений и помещений для самостоятельной работы |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1 | 2 |
| Учебная аудитория (1 учебный корпус, 502 аудитория) | Средства мультимедиа |
| Учебная аудитория (15 учебный корпус, 226 аудитория) | Средства мультимедиа |
| Учебная аудитория (12 учебный корпус, 7 аудитория) | Компьютерный класс на 26 компьютеров |
| Учебная аудитория (12 учебный корпус, 12 аудитория) | Компьютерный класс на 22 компьютера |
| Учебная аудитория (12 учебный корпус, 13 аудитория) | Компьютерный класс на 26 компьютеров |
| Учебная аудитория (15 учебный корпус, 102 аудитория) | Компьютерный класс на 21 компьютер |
| Учебная аудитория (15 учебный корпус, 113 аудитория) | Компьютерный класс на 20 компьютеров |
| Учебная аудитория (15 учебный корпус, 114 аудитория) | Компьютерный класс на 17 компьютеров |
| Учебная аудитория (15 учебный корпус, 110 аудитория) | Компьютерный класс на 18 компьютеров |
| Учебная аудитория (15 учебный корпус, 118 аудитория) | Компьютерный класс на 18 компьютеров |
| ЦНБ имени Н.И. Железнова | Читальные залы |
| Помещения для самостоятельной работы студентов: Корпус 2, аудитория 321; | 1. Столы – 7 шт. (инв. номер: 632634, 625631, 591194) 2. Стулья – 21 шт. (инв. номер 558590) 3. Проектор NEC NP 200 (G) – 1 шт. (инв. номер 210134000002612) 4. Ноутбук HP 6720s – 1 шт. (инв. номер 210134000006213) 5. Маркерная доска – 1 шт. 6. Компьютеры для индивидуальной работы |

11. Методические рекомендации студентам по освоению дисциплины

Образовательный процесс по дисциплине «Системный анализ рисков» организован в форме учебных занятий (контактная работа (аудиторной и внеаудиторной) обучающихся с преподавателем и самостоятельная работа обучающихся). Учебные занятия (в том числе по реализации практической подготовки) представлены следующими видами, включая учебные занятия, направленные на практическую подготовку обучающихся и проведение текущего контроля успеваемости: лекции, практические занятия, иные учебные занятия, предусматривающие индивидуальную работу преподавателя с обучающимся, самостоятельная работа обучающихся.

На учебных занятиях обучающиеся выполняют запланированные настоящей программой отдельные виды учебных работ, в том числе отдельных элементов работ, связанных с будущей профессиональной деятельностью.

Виды и формы отработки пропущенных занятий

Студент, пропустивший лекцию, обязан сдать реферат в виде блок-схемы по основным вопросам темы лекции.

Студент, пропустивший практические занятия, обязан сдать письменный отчет по проблемной ситуации, рассматриваемой на практическом занятии, и пройти мероприятия текущего контроля.

12. Методические рекомендации преподавателям по организации обучения по дисциплине

Изучаемые в рамках дисциплины «Системный анализ рисков» темы взаимосвязаны между собой и с материалами ранее изученных дисциплин. Следовательно, преподавателю целесообразно обращать внимание студентов на системность изучаемого материала в аспектах специализации «Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности».

Для облегчения студентам восприятия материала по дисциплине «Системный анализ рисков» много времени уделяется активным и интерактивным образовательным технологиям, что способствует преодолению пассивности обучающихся.

Программу разработали:

к.э.н., доцент Катков Ю.Н.

к.э.н., доцент Каткова Е.А.



РЕЦЕНЗИЯ
на рабочую программу дисциплины
Б1.В.10.12 Системный анализ рисков
ОПОП ВО по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность, специализации
Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
(квалификация выпускника – экономист)

Хоружий Людмилой Ивановной, директором института экономики и управления АПК, профессором кафедры бухгалтерского учета и налогообложения ФГБОУ ВО «РГАУ-МСХА имени К.А. Тимирязева», доктором экономических наук, профессором (далее по тексту рецензент), проведено рецензирование рабочей программы дисциплины «Системный анализ рисков» ОПОП ВО специальности 38.05.01 Экономическая безопасность, специализации Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности (квалификация выпускника – экономист), разработанной в ФГБОУ ВО «РГАУ-МСХА имени К.А. Тимирязева», на кафедре экономической безопасности, анализа и аудита (разработчики Катков Ю.Н., к.э.н., доцент и Каткова Е.А., к.э.н., доцент).

Рассмотрев представленные на рецензию материалы, рецензент пришел к следующим выводам:

1. Предъявленная рабочая программа дисциплины «Системный анализ рисков» (далее по тексту Программа) соответствует требованиям ФГОС ВО по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность. Программа содержит все основные разделы, соответствует требованиям к нормативно-методическим документам.

2. Представленная в Программе актуальность учебной дисциплины в рамках реализации ОПОП ВО не подлежит сомнению – дисциплина относится к части, формируемую участниками образовательных отношений блока Б1.В.

3. Представленные в Программе цели дисциплины соответствуют требованиям ФГОС ВО по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность.

4. В соответствии с Программой за дисциплиной «Системный анализ рисков» закреплены 6 компетенции. Дисциплина «Системный анализ рисков» и представленная Программа способна реализовать их в объявленных требованиях.

5. Результаты обучения, представленные в Программе в категориях знать, уметь, владеть соответствуют специфике и содержанию дисциплины и демонстрируют возможность получения заявленных результатов.

6. Общая трудоёмкость дисциплины «Системный анализ рисков» составляет 3 зачётные единицы (108 часа), что позволяет освоить дисциплину в рамках необходимой компетентности выпускников.

7. Информация о взаимосвязи изучаемых дисциплин и вопросам исключения дублирования в содержании дисциплин соответствует действительности. Дисциплина «Системный анализ рисков» взаимосвязана с другими дисциплинами ОПОП ВО и Учебного плана по специальности 38.05.01 «Экономическая безопасность» и возможность дублирования в содержании отсутствует. Поскольку дисциплина не предусматривает наличие специальных требований к входным знаниям, умениям и компетенциям студента, хотя может являться предшествующей для специальных, в том числе профессиональных дисциплин, использующих знания в области судебной экономической экспертизы в профессиональной деятельности специалиста по данной специальности.

8. Представленная Программа предполагает использование современных образовательных технологий, используемых при реализации различных видов учебной работы. Формы образовательных технологий соответствуют специфике дисциплины.

9. Программа дисциплины предполагает занятия в интерактивной форме.

10. Виды, содержание и трудоёмкость самостоятельной работы студентов, представленные в Программе, соответствуют требованиям к подготовке выпускников, содержащимся во ФГОС ВО по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность.

11. Представленные и описанные в Программе формы *текущей* оценки знаний (выполнение и защита практических заданий, контрольные работы), соответствуют специфике дисциплины и требованиям к выпускникам.

Форма промежуточного контроля знаний студентов, предусмотренная Программой, осуществляется в виде экзамена во 6 семестре, что соответствует требованиям для дисциплин данного объема и Учебному плану.

12. Формы оценки знаний, представленные в Программе, соответствуют специфике дисциплины и требованиям к выпускникам.

13. Учебно-методическое обеспечение дисциплины представлено: основной литературой – 2 источника (базовых учебников), дополнительной литературой – 3 наименований, Интернет-ресурсами – 8 источников, информационно-справочные и поисковые системы и соответствует требованиям ФГОС ВО специальности 38.05.01 – Экономическая безопасность.

14. Материально-техническое обеспечение дисциплины соответствует специфике дисциплины «Системный анализ рисков» и обеспечивает использование современных образовательных, в том числе интерактивных методов обучения.

15. Методические рекомендации студентам и методические рекомендации преподавателям по организации обучения по дисциплине дают представление о специфике обучения по дисциплине «Системный анализ рисков».

ОБЩИЕ ВЫВОДЫ

На основании вышеизложенного можно сделать заключение, что характер, структура и содержание рабочей программы дисциплины «Системный анализ рисков» ОПОП ВО по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность специализации Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности (квалификация выпускника – экономист), разработанная Катковым Ю.Н. и Катковой Е.А. соответствует требованиям ФГОС ВО, современным требованиям экономики, рынка труда и позволит при её реализации успешно обеспечить формирование заявленных компетенций.

Рецензент: Рецензент: Хоружий Людмила Ивановна, директор института экономики и управления АПК, профессор кафедры бухгалтерского учета и налогообложения ФГБОУ ВО «Российский государственный аграрный университет - МСХА имени К.А. Тимирязева», доктор экономических наук



«01» июня 2022 г.