

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:

ФИО: Кандрашина Елена Александровна

Должность: И.о. ректора ФГАОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 08.08.2024 13:26:33

Уникальный программный ключ:

2db64eb9605ce27edd3b8e8fdd32c70e0674ddd2

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации**  
**Федеральное государственное автономное образовательное учреждение**  
**высшего образования**  
**«Самарский государственный экономический университет»**

**Институт**      Институт экономики предприятий

**Кафедра**      Метакафедра (УМУ)

**УТВЕРЖДЕНО**

Ученым советом Университета

(протокол № 10 от 30 мая 2024 г.)

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА**

**Наименование дисциплины**      Б1.О.21 Управление рисками

**Основная профессиональная образовательная программа**      09.03.03 Прикладная информатика программа  
Интеллектуальные цифровые системы и сервисы  
в управлении

Квалификация (степень) выпускника Бакалавр

Самара 2024

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации  
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Самарский государственный экономический университет»**

**Институт**    Институт экономики предприятий  
**Кафедра**    Метакафедра (УМУ)

**АННОТАЦИЯ**

**Наименование дисциплины**    Б1.О.21 Управление рисками

**Основная профессиональная образовательная программа**    09.03.03 Прикладная информатика программа  
Интеллектуальные цифровые системы и сервисы  
в управлении

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации  
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Самарский государственный экономический университет»**

**Институт**    Институт экономики предприятий  
**Кафедра**    Метакафедра (УМУ)

**УТВЕРЖДЕНО**  
Ученым советом Университета  
(протокол № от 30 мая 2024 г.)

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ  
ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ**

<b>Наименование дисциплины</b>	Б1.О.21 Управление рисками
<b>Основная профессиональная образовательная программа</b>	09.03.03 Прикладная информатика программа Интеллектуальные цифровые системы и сервисы в управлении

## Содержание (рабочая программа)

Стр.

- 1 Место дисциплины в структуре ОП
- 2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 3 Объем и виды учебной работы
- 4 Содержание дисциплины
- 5 Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины
- 6 Фонд оценочных средств по дисциплине

## Содержание (ФОС)

Стр.

- 6.1 Контрольные мероприятия по дисциплине
- 6.2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 6.3 Паспорт оценочных материалов
- 6.4 Оценочные материалы для текущего контроля
- 6.5 Оценочные материалы для промежуточной аттестации
- 6.6 Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

Целью изучения дисциплины является формирование результатов обучения, обеспечивающих достижение планируемых результатов освоения образовательной программы.

## 1. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Управление рисками входит в обязательную часть блока Б1.Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Предпринимательское дело, Основы менеджмента, Современные цифровые платформы, Проектирование баз знаний, Информационные технологии цифровой экономики

## 2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Изучение дисциплины Управление рисками в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

### Общепрофессиональные компетенции (ОПК):

ОПКМ-3 - Способен разрабатывать обоснованные организационно-управленческие решения с учетом их социальной значимости, содействовать их реализации в условиях сложной и динамичной среды и оценивать их последствия

Планируемые результаты обучения по программе	<b>Планируемые результаты обучения по дисциплине</b>		
	ОПКМ-3.1: Знать:	ОПКМ-3.2: Уметь:	ОПКМ-3.3: Владеть (иметь навыки):
	методы оценки проблемных ситуаций в деятельности организаций, подходы к разработке и обоснованию организационно-управленческих решений с учетом их социальной значимости, методы оценки организационно-управленческих решений в условиях сложной и динамичной среды	анализировать и оценивать проблемные организационно-управленческие ситуации в деятельности организации, оценивать социальную значимость предлагаемых организационно-управленческих решений, оценивать результативность принятия организационно-управленческих решений в условиях сложной и динамичной среды	навыками разработки и содействия реализации обоснованных организационно-управленческих решений с учетом их социальной значимости, навыками оценки последствий этих решений

ОПКМ-2 - Способен осуществлять сбор, обработку и анализ данных, необходимых для решения поставленных управленческих задач, с использованием современного инструментария и интеллектуальных информационно-аналитических систем

Планируемые результаты обучения по программе	<b>Планируемые результаты обучения по дисциплине</b>		
	ОПКМ-2.1: Знать:	ОПКМ-2.2: Уметь:	ОПКМ-2.3: Владеть (иметь навыки):
	основные варианты управления бизнес-процессами цифрового предприятия; методы описания и анализа проблемных ситуаций деятельности организации, используя профессиональную	готовить аналитические материалы, связанные с оценкой уровня цифровой трансформации, интеграции новых бизнес-процессов в бизнес-деятельность цифровых предприятий	методами описания бизнес-процессов цифрового предприятия

	терминологию и технологии управления		
--	--------------------------------------	--	--

### 3. Объем и виды учебной работы

Учебным планом предусматриваются следующие виды учебной работы по дисциплине:

#### Очная форма обучения

Виды учебной работы	Всего час/ з.е.
	Сем 7
Контактная работа, в том числе:	54.15/1.5
Занятия лекционного типа	18/0.5
Занятия семинарского типа	36/1
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.15/0
Самостоятельная работа:	35.85/1
Промежуточная аттестация	18/0.5
Вид промежуточной аттестации:	
Зачет	Зач
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	108
Зачетные единицы	3

### 4. Содержание дисциплины

#### 4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Управление рисками представлен в таблице.

#### Разделы, темы дисциплины и виды занятий

##### Очная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контактная работа				Самостоятельная работа	Планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по образовательной программе
		Лекции	Занятия семинарского типа		ИКР		
			Практич. занятия	ГКР			
1.	Основы теории принятия рискованных решений	8	16			20	ОПКМ-3.1, ОПКМ -3.2, ОПКМ-3.3, ОПКМ-2.1, ОПКМ -2.2, ОПКМ-2.3
2.	Методы оценки и управления рисками	10	20			15,85	ОПКМ-3.1, ОПКМ -3.2, ОПКМ-3.3, ОПКМ-2.1, ОПКМ -2.2, ОПКМ-2.3
	Контроль	18					
	<b>Итого</b>	<b>18</b>	<b>36</b>	<b>0.15</b>		<b>35.85</b>	

#### 4.2 Содержание разделов и тем

##### 4.2.1 Контактная работа

Тематика занятий лекционного типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия лекционного типа*	Тематика занятия лекционного типа
1.	Основы теории принятия рискованных решений	лекция	Неопределенность и риск. Введение в теорию рисков
		лекция	Факторы риска
		лекция	Стратегии рискованных решений и основные методы управления риском
		лекция	Управленческий механизм риск-менеджмента
2.	Методы оценки и управления риском	лекция	Измерение риска и критерии принятия рискованных решений
		лекция	Методы оценки рисков
		лекция	Основные инструменты риск-менеджмента. Приемы и способы управления рисками.
		лекция	Методы учета рисков долгосрочных инвестиционных проектов. Управление рисками проекта.
		лекция	Портфельное инвестирование. Риск портфеля активов.

\*лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся

#### Тематика занятий семинарского типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия семинарского типа**	Тематика занятия семинарского типа
1.	Основы теории принятия рискованных решений	практическое занятие	Нестабильность, неопределенность и риск.
		практическое занятие	Введение в теорию риска
		практическое занятие	Понятие и виды рисков
		практическое занятие	Факторы риска
		практическое занятие	Стратегии рискованных решений
		практическое занятие	Тактические решения в сфере риск-менеджмента
		практическое занятие	Этапы управления риском
		практическое занятие	Риск-менеджмент в организации
2.	Методы оценки и управления риском	практическое занятие	Измерение риска и критерии принятия рискованных решений
		практическое занятие	Методы оценки рисков
		практическое занятие	Основные инструменты риск-менеджмента. Приемы и способы управления рисками.
		практическое занятие	Количественные методы оценки риска
		практическое занятие	Метод экспертных оценок
		практическое занятие	Методы учета рисков долгосрочных инвестиционных проектов. Управление рисками проекта.

			Метод анализа чувствительности проекта
		практическое занятие	Методы учета рисков долгосрочных инвестиционных проектов. Управление рисками проекта. Сценарный метод
		практическое занятие	Портфельное инвестирование.
		практическое занятие	Риск портфеля активов.

\*\* семинары, практические занятия, практикумы, лабораторные работы, коллоквиумы и иные аналогичные занятия

### Иная контактная работа

При проведении учебных занятий СГЭУ обеспечивает развитие у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств (включая при необходимости проведение интерактивных лекций, групповых дискуссий, ролевых игр, тренингов, анализ ситуаций и имитационных моделей, преподавание дисциплин (модулей) в форме курсов, составленных на основе результатов научных исследований, проводимых организацией, в том числе с учетом региональных особенностей профессиональной деятельности выпускников и потребностей работодателей).

Формы и методы проведения иной контактной работы приведены в Методических указаниях по основной профессиональной образовательной программе.

#### 4.2.2 Самостоятельная работа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид самостоятельной работы ***
1.	Основы теории принятия рискованных решений	- подготовка электронной презентации - тестирование
2.	Методы оценки и управления риском	- подготовка электронной презентации - тестирование

\*\*\* самостоятельная работа в семестре, написание курсовых работ, докладов, выполнение контрольных работ

## 5. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

### 5.1 Литература:

#### Основная литература

1. Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 485 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12206-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/536576>

#### Дополнительная литература

1. Пименов, Н. А. Управление финансовыми рисками в системе экономической безопасности : учебник и практикум для вузов / Н. А. Пименов. — 3-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 353 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16342-1. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/535920>

2. Шкурко, В. Е. Управление рисками проекта : учебник для вузов / В. Е. Шкурко ; под научной редакцией А. В. Гребенкина. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 163 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16836-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/540420>

#### Литература для самостоятельного изучения

1. Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 721 с. — (Высшее образование)

образование). — ISBN 978-5-534-17939-2. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/545113>

2.Борисова, О. В. Основы организации инвестиционной деятельности и управление рисками : учебник и практикум для среднего профессионального образования / О. В. Борисова, Н. И. Малых, Л. В. Овешникова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 159 с. — (Профессиональное образование). — ISBN 978-5-534-17339-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/545021>

3.Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 365 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-3502-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/536005>

4.Страхование и управление рисками : учебник для вузов / Г. В. Чернова [и др.] ; под редакцией Г. В. Черновой. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 767 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-3042-9. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/534020>

## **5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения**

1. Astra Linux Special Edition «Смоленск», «Орел»; РедОС
2. МойОфис Стандартный 2, МойОфис Образование, Р7-Офис Профессиональный

## **5.3 Современные профессиональные базы данных, к которым обеспечивается доступ обучающихся**

1. Профессиональная база данных «Информационные системы Министерства экономического развития Российской Федерации в сети Интернет» (Портал «Официальная Россия» - <http://www.gov.ru/>)

2. Государственная система правовой информации «Официальный интернет-портал правовой информации» (<http://pravo.gov.ru/>)

3. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/ru/>)

4. Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики - <http://www.gks.ru/>)

## **5.4. Информационно-справочные системы, к которым обеспечивается доступ обучающихся**

1. Справочно-правовая система «Консультант Плюс»
2. Справочно-правовая система «ГАРАНТ-Максимум»

## **5.5. Специальные помещения**

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран
Учебные аудитории для проведения практических занятий (занятий семинарского типа)	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор

	Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для самостоятельной работы	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для хранения и профилактического обслуживания оборудования	Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования

## 5.6 Лаборатории и лабораторное оборудование

## 6. Фонд оценочных средств по дисциплине Управление рисками:

### 6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

Вид контроля	Форма контроля	Отметить нужное знаком « + »
Текущий контроль	Оценка презентаций	+
	Устный/письменный опрос	-
	Тестирование	+
	Практические задачи	+
	Оценка контрольных работ (для заочной формы обучения)	-
Промежуточный контроль	Зачет	+

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования; Положением о балльно-рейтинговой системе оценки успеваемости обучающихся по основным образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры в федеральном государственном автономном образовательном учреждении высшего образования «Самарский государственный экономический университет».

### 6.2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

#### Общепрофессиональные компетенции (ОПК):

ОПКМ-3 - Способен разрабатывать обоснованные организационно-управленческие решения с учетом их социальной значимости, содействовать их реализации в условиях сложной и динамичной среды и оценивать их последствия

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ОПКМ-3.1: Знать:  методы оценки проблемных ситуаций в деятельности организаций, подходы к разработке и обоснованию организационно-	ОПКМ-3.2: Уметь:  анализировать и оценивать проблемные организационно-управленческие ситуации в деятельности организации, оценивать социальную	ОПКМ-3.3: Владеть (иметь навыки):  навыками разработки и содействия реализации обоснованных организационно-

	управленческих решений с учетом их социальной значимости, методы оценки организационно-управленческих решений в условиях сложной и динамичной среды	значимость предлагаемых организационно-управленческих решений, оценивать результативность принятия организационно-управленческих решений в условиях сложной и динамичной среды	управленческих решений с учетом их социальной значимости, навыками оценки последствий этих решений
Пороговый	методы оценки проблемных ситуаций и организационно-управленческих решений, методы количественного и качественного анализа рисков	на основе анализа сложной динамической среды, обобщения и систематизации информации идентифицировать риски, оценивать вероятность их реализации и результативность принятия организационно-управленческих решений	отдельными методами оценки рисков при диагностике состояния экономической, социальной, политической среды
Стандартный (в дополнение к пороговому)	природу рисков, основные способы и приемы управления рисками	на основе анализа сложной динамической среды, обобщения и систематизации информации с использованием инструментов количественного и качественного анализа идентифицировать и оценивать риски и результативность принятия организационно-управленческих решений	методами количественной и качественной оценки рисков при диагностике состояния экономической, социальной, политической среды
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	теорию принятия рискованных решений, методы управления рисками	на основе оценки рисков, вероятностных прогнозов их возникновения, обосновывать управленческие решения, оценивать результативность их реализации в условиях сложной и динамической среды	методами оценки и прогнозирования рисков, определения потенциальных потерь при диагностике состояния экономической, социальной и политической среды

ОПКМ-2 - Способен осуществлять сбор, обработку и анализ данных, необходимых для решения поставленных управленческих задач, с использованием современного инструментария и интеллектуальных информационно-аналитических систем

Планируемые результаты обучения по программе	<b>Планируемые результаты обучения по дисциплине</b>		
	ОПКМ-2.1: Знать: основные варианты управления бизнес-	ОПКМ-2.2: Уметь: готовить аналитические материалы, связанные с	ОПКМ-2.3: Владеть (иметь навыки): методами описания бизнес-процессов

	процессами цифрового предприятия; методы описания и анализа проблемных ситуаций деятельности организации, используя профессиональную терминологию и технологии управления	оценкой уровня цифровой трансформации, интеграции новых бизнес-процессов в бизнес-деятельность цифровых предприятий	цифрового предприятия
Пороговый	теорию рисков в управлении бизнес-процессами цифрового предприятия	разрабатывать аналитические материалы в связанные с оценкой уровня цифровой трансформации, на основе анализа потенциальных рисков и потерь цифровых предприятий	отдельными методами оценки рисков при описании бизнес-процессов цифрового предприятия
Стандартный (в дополнение к пороговому)	природу рисков, анализ проблемных ситуаций основные способы и приемы управления рисками	разрабатывать аналитические материалы в связанные с оценкой уровня цифровой трансформации, интеграции новых бизнес-процессов с учетом возможных рисков цифровых предприятий и возможностей их устранения	методами количественной и качественной оценки рисков при описании бизнес-процессов цифрового предприятия
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	теорию принятия рискованных решений, методы управления рисками	разрабатывать аналитические материалы в связанные с оценкой уровня цифровой трансформации, интеграции новых бизнес-процессов, оценивать социально-экономические последствия их реализации	методами оценки и прогнозирования рисков, определения потенциальных потерь при описании бизнес-процессов цифрового предприятия

### 6.3. Паспорт оценочных материалов

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контролируемые планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по программе	Вид контроля/используемые оценочные средства	
			Текущий	Промежуточный
1.	Основы теории принятия рискованных решений	ОПКМ-3.1, ОПКМ-3.2, ОПКМ-3.3, ОПКМ-2.1, ОПКМ-2.2, ОПКМ-2.3	Оценка презентаций Тестирование Практические задачи	Зачет
2.	Методы оценки и управления риском	ОПКМ-3.1, ОПКМ-3.2, ОПКМ-3.3, ОПКМ-2.1, ОПКМ-2.2, ОПКМ-2.3	Оценка презентаций Тестирование Практические задачи	Зачет

### 6.4. Оценочные материалы для текущего контроля

### 6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

## Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме зачета

Раздел дисциплины	Вопросы
Основы теории принятия рискованных решений	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Место и роль рисков в экономической деятельности</li> <li>2. Особенности рисков предпринимательской деятельности</li> <li>3. Управление рисками как специфическая область менеджмента</li> <li>4. Сущность риск-менеджмента как системы управления риском и экономическими отношениями</li> <li>5. Процесс управления риском и его основные этапы</li> <li>6. Особенности принятия решений в условиях неопределенности будущих результатов</li> <li>8. Внешние риски</li> <li>9. Внутренние риски</li> <li>10. Этапы управления рисками и их характеристика</li> <li>11. Идентификация рисков.</li> <li>12. Характеристика оценки и анализа рисков. Выбор методов оценки, адекватных каждому виду рисков</li> <li>13. Содержание и основные принципы разработки стратегий управления рисками</li> <li>14. Характеристика основных стратегий управления риском</li> <li>15. Основные мероприятия тактики управления рисками</li> <li>16. Косвенные методы учета риска</li> </ol>
Методы оценки и управления риском	<ol style="list-style-type: none"> <li>17. Направления отражения риска в расчетах эффективности инвестиций</li> <li>18. Классификация направлений и методов оценки риска</li> <li>19. Учет рисков в исходной информации</li> <li>20. Учет рисков при обосновании рискованной премии</li> <li>21. Экспертный метод обоснования величины рискованной премии</li> <li>22. Статистический метод обоснования риска</li> <li>23. Графическая интерпретация риска в зависимости от величины потерь</li> <li>24. Характеристика вероятностных показателей оценки риска: дисперсии, среднего квадратичного отклонения, коэффициента вариации</li> <li>25. Использование бета-коэффициентов для оценки уровня инвестиционного риска</li> <li>26. Использование ценовой модели капитальных активов (САРМ) для расчета дохода по инвестиционному проекту с учетом риска</li> <li>27. Содержание поэлементного и агрегированного расчета рискованной премии</li> <li>28. Содержание и этапы проведения анализа чувствительности</li> <li>29. Метод сценариев как один из способов анализа чувствительности</li> <li>30. Использование метода имитационного моделирования для анализа инвестиционных рисков</li> <li>35. Этапы реализации метода имитационного моделирования</li> </ol>

### 6.6. Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

#### Шкала и критерии оценивания

Оценка	Критерии оценивания для мероприятий контроля с применением 2-х балльной системы
«зачтено»	ОПКМ-3, ОПКМ-2
«не зачтено»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне