СОЧИНСКИЙ ИНСТИТУТ (ФИЛИАЛ)
федерального государственного автономного образовательного
учреждения высшего образования
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ ДРУЖБЫ НАРОДОВ ИМЕНИ ПАТРИСА ЛУМУМБЫ»

Экономический факультет

Кафедра национальной и мировой экономики

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Петенко Александр Тимофеевич
Должность: Директор
Дата подписания: 28.04.2025
Уникальный программный ключ:
28acbc88a6d3ce11b5b992501f9a43df0be7b81d

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

"Системный анализ и менеджмент рисков"

(наименование дисциплины)

Рекомендована МССН для направления подготовки/специальности:

38.04.01 "Экономика"

(код и наименование направления подготовки/специальности)

Освоение дисциплины ведется в рамках реализации основной профессиональной образовательной программы высшего образования (ОП ВО):

"Финансовая экономика"

(наименование (профиль/специализация) ОП ВО)

Сочи,
2025 г.

1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Целью освоения дисциплины «Системный анализ и менеджмент рисков» является являются изучение и освоение магистрантами теории и методов принятия решений в экономике и бизнесе в условиях неопределенности и риска.
Задачами дисциплины являются: приобретение магистрантами практических навыков формирования основных целей и задач управления, и планирования производственной, и финансовой деятельности экономических субъектов, а также разработки и применения экономико-математических моделей анализа ситуаций принятия решений и выбора лучших решений в условиях неопределенности и риска.

2. ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Освоение дисциплины «Системный анализ и менеджмент рисков» направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций (части компетенций):

Таблица 2.1. Перечень компетенций, формируемых у обучающихся при освоении дисциплины (результаты освоения дисциплины)

Шифр	**КОМПЕТЕНЦИЯ**
	Индикаторы достижения компетенции (в рамках данной дисциплины)
УК-1	**Способен осуществлять поиск, критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий**
УК-1.1	Анализирует задачу, выделяя ее базовые составляющие
УК-1.2	Определяет и ранжирует информацию, требуемую для решения поставленной задачи
УК-1.3	Осуществляет поиск информации для решения поставленной задачи по различным типам запросов
УК-1.4	Предлагает варианты решения задачи, анализирует возможные последствия их использования
УК-1.5	Анализирует пути решения проблем мировоззренческого, нравственного и личностного характер на основе использования основных философских идей и категорий в их историческом развитии и социально-культурном контексте
ОПК-5	**Способен использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач**
ОПК-5.1	Знает современные информационные технологии и программные средства, используемые для решения аналитических и исследовательских задач
ОПК-5.2	Умеет использовать современные информационные технологии и программные средства для решения профессиональных задач
ОПК-5.3	Владеет навыком использовать современные информационные технологии и программные средства для решения профессиональных задач
ПК-7	**Способен управлять бизнес-анализом и осуществлять аналитическое обеспечение разработки стратегии изменений организации**
ПК-7.1	Знает методики оценки деятельности в соответствии с разработанными показателями, сбора, анализа, систематизации, хранения и поддержания в актуальном состоянии информации бизнес-анализа
ПК-7.2	Умеет оформлять результаты бизнес-анализа в соответствии с выбранными подходами, анализировать и классифицировать риски и разрабатывать комплекс мероприятий по их минимизации, применять информационные технологии в объеме, необходимом для целей бизнес-анализа

ПК-7.3	Владеет навыками сбора информации, анализа, оценки эффективности проводимого бизнес-анализа в организации, методикой оценки бизнес-возможностей организации, необходимых для проведения стратегических изменений в организации
ПК-9	**Способен планировать и прогнозировать экономическую деятельность организации**
ПК-9.1	Знает нормативные правовые акты, регулирующие финансово-хозяйственную деятельность организации, принципы, методы и инструменты проектного управления, порядок разработки нормативов материальных, трудовых, финансовых ресурсов в соответствии с отраслевой направленностью, методы экономико-математического и статистического анализа и учета показателей деятельности организации и ее подразделений
ПК-9.2	Умеет составлять бизнес-проекты, перспективные и годовые планы и отчеты о деятельности организации, анализировать финансово-экономическую отчетность организации, принимать организационно-управленческие решения, которые могут привести к повышению экономической эффективности организации
ПК-9.3	Владеет навыком разработки эконометрических и финансово-экономических моделей исследуемых процессов, явлений и объектов, относящихся к сфере профессиональной деятельности, оценки и интерпретации полученных результатов с применением информационных технологий

3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОП ВО

Дисциплина «Системный анализ и менеджмент рисков» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений блока Б1.В ОП ВО.

В рамках ОП ВО обучающиеся также осваивают другие дисциплины и/или практики, способствующие достижению запланированных результатов освоения дисциплины «Системный анализ и менеджмент рисков».

Таблица 3.1. Перечень компонентов ОП ВО, способствующих достижению запланированных результатов освоения дисциплины

Шифр	Наименование компетенции	Предшествующие дисциплины, практики*	Последующие дисциплины, практики*
УК-1	Способен осуществлять поиск, критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий	Государственно-частное партнерство в развитии экономики регионов Курсовая работа "Экономическая политика и финансы российских регионов" Научно-исследовательская работа (получение первичных навыков научно-исследовательской работы) Финансовые стратегии предприятия Экономическая политика и финансы российских регионов	Научно-исследовательская работа (по теме выпускной квалификационной работы)

ОПК-5	Способен использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач	Цифровые технологии в финансовой сфере Эконометрика (продвинутый курс)	Преддипломная практика
ПК-7	Способен управлять бизнес-анализом и осуществлять аналитическое обеспечение разработки стратегии изменений организации	Государственно-частное партнерство в развитии экономики регионов Эконометрика (продвинутый курс)	Преддипломная практика
ПК-9	Способен планировать и прогнозировать экономическую деятельность организации	Корпоративные финансы (продвинутый курс) Микроэкономика (продвинутый курс) Финансовые стратегии предприятия	Преддипломная практика

* - заполняется в соответствии с матрицей компетенций и СУП ОП ВО

4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ И ВИДЫ УЧЕБНОЙ РАБОТЫ

Общая трудоемкость дисциплины «Системный анализ и менеджмент рисков» составляет 3 з.е.

Таблица 4.1. Виды учебной работы по периодам освоения ОП ВО для очной формы обучения.

Вид учебной работы	**Всего, ак. ч.**	**Семестр(-ы)**					
		3					
Контактная (аудиторная) работа (всего)	24	24					
в том числе:	-	-	-	-	-	-	-
лекции (если предусмотрено)	12	12					
в том числе в форме практической подготовки (если предусмотрено)	1	1					
лабораторные занятия (если предусмотрено)	-	-					
в том числе в форме практической подготовки (если предусмотрено)	-	-					
практические занятия (если предусмотрено)	12	12					
в том числе в форме практической подготовки (если предусмотрено)	4	4					
Самостоятельная работа обучающегося (всего)	84	84					
в том числе:	-	-	-	-	-	-	-
в форме практической подготовки (если предусмотрено)	14	14					
Часов на контроль:	-	-					
Промежуточная аттестация в форме: (зачет/дифзачет/ экзамен)	-	ЗаО					
Общая трудоемкость час	108	108					
зач. ед.	3	3	-				

5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ/МОДУЛЯ

Таблица 5.1. Содержание дисциплины (модуля) по видам учебной работы

НАИМЕНОВАНИЕ РАЗДЕЛА ДИСЦИПЛИНЫ Содержание раздела (темы)	Вид учебной работы*
Раздел 1. Теоретические основы понятия риска и принятия оптимальных решений	
Тема 1.1. Риск и классификация рисковой ситуации	ЛК
Тема 1.1. Риск и классификация рисковой ситуации	ПЗ
Тема 1.1. Риск и классификация рисковой ситуации	СР
Тема 1.2. Принятие решений в условиях неопределенности и риска	ЛК
Тема 1.2. Принятие решений в условиях неопределенности и риска	ПЗ
Тема 1.2. Принятие решений в условиях неопределенности и риска	СР
Раздел 2. Процесс принятия правильных решений и управления рисками	
Тема 2.1. Дерево решений	ЛК
Тема 2.1. Дерево решений	ПЗ
Тема 2.1. Дерево решений	СР
Тема 2.2. Процесс управления рисками	ЛК
Тема 2.2. Процесс управления рисками	ПЗ
Тема 2.2. Процесс управления рисками	СР

* - ЛК – лекции; ЛР – лабораторные работы; ПЗ – практические занятия; СР – самостоятельная работа.

6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Таблица 6.1. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Тип аудитории	Оснащение аудитории	Специализированное учебное/ лабораторное оборудование, ПО и материалы для освоения дисциплины (при необходимости)
Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации	Комплект специализированной мебели; маркерная доска; кафедра; автоматизированное рабочее место преподавателя - компьютер: процессор мощностью не ниже Intel Core i3, монитор LCD не менее 24", Интерактивная панель 86" / проектор Epson; проекционный экран / Телевизор LED 43", имеется выход в интернет	Операционная система Windows 10 Pro Схема лицензирования per-device, номер лицензии 87846770 от 27.05.19 по гос.контракту №31907740983 на ПО ООО “БалансСофт Проекты»; Office Professional 2007 45747882, 46074549 Акт приема-передачи №АПП-95 от 17.07.09 по

Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации	Комплект специализированной мебели; интерактивная панель 86", доска аудиторная меловая; автоматизированные рабочие места - компьютер: процессор мощностью не ниже Intel Core i3, оперативная память объемом не менее 8 ГБ, память SSD 250 ГБ/HDD 1 ТБ, видеокарта NVIDIA 1050TI 4ГБ; монитор LCD не менее 24"; имеется выход в интернет	гос.контракту № 69-09 на программное обеспечение ООО "Микро Лана", Kaspersky Endpoint security для бизнеса - Стандартный 1752-150211-132016 Акт приема-передачи №275 от 21.12.09 по гос.контракту № 83-09 на программное обеспечение ООО "Виста"
Аудитория для самостоятельной работы обучающихся	Комплект специализированной мебели; Телевизор LED 65", автоматизированные рабочие места (процессор не ниже Intel Core i3, оперативная память объемом не менее 6 ГБ; SSD 250 ГБ/HDD 1 ТБ), имеется выход в интернет	

7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Основная литература:

1. Матвеева Л. Г., Никитаева А. Ю., Чернова О. А., Щипанов Е. Ф. Управление инвестиционными проектами в условиях риска и неопределенности : Учебное пособие для вузов. - Москва: Юрайт, 2021. - 298 с - Текст : электронный. - URL: https://urait.ru/bcode/471579

2. Белов П. Г. Системный анализ и программно-целевой менеджмент рисков : Учебник и практикум для вузов. - Москва: Юрайт, 2022. - 289 с - Текст : электронный. - URL: https://urait.ru/bcode/493057

3. Шкурко В. Е., Гребенкин А. В. Управление рисками проекта : учебное пособие для вузов. - Москва: Юрайт, 2022. - 182 с - Текст : электронный. - URL: https://urait.ru/bcode/493673

4. Прокофьева Т. А., Челноков В. В. Системный анализ в менеджменте : Учебник для вузов. - Москва: Юрайт, 2022. - 313 с - Текст : электронный. - URL: https://urait.ru/bcode/495119

5. Воронцовский А. В. Управление инвестициями: инвестиции и инвестиционные риски в реальном секторе экономики : Учебник и практикум для вузов. - Москва: Юрайт, 2022. - 391 с - Текст : электронный. - URL: https://urait.ru/bcode/496231

6. Вяткин В. Н., Гамза В. А., Маевский Ф. В. Риск-менеджмент : Учебник. - Москва: Юрайт, 2022. - 365 с - Текст : электронный. - URL: https://urait.ru/bcode/489098

7. Воронцовский А. В. Управление рисками : Учебник и практикум для вузов. - Москва: Юрайт, 2022. - 485 с - Текст : электронный. - URL: https://urait.ru/bcode/489580

8. Воронцовский А.В. Управление рисками : Учебник и практикум для вузов. - Москва: Юрайт, 2019. - 485 с. - Текст : электронный. - URL:

Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:

1. ЭБС РУДН и сторонние ЭБС, к которым студенты университета имеют доступ на основании заключенных договоров:

- научная электронная библиотека eLIBRARY.RU https://www.elibrary.ru/
- ЭБС Znanium https://znanium.ru
- ЭБС «Университетская библиотека онлайн» http://biblioclub.ru
- Образовательная платформа Юрайт https://urait.ru
- Электронно-библиотечная система РУДН – ЭБС РУДН http://mega.rudn.ru/MegaPro/Web

2. Базы данных и поисковые системы:

- реферативная база данных SCOPUS http://www.elsevierscience.ru/products/scopus/
- поисковая система Яндекс https://www.yandex.ru/
- справочная правовая система «Консультант Плюс» http://www.consultant.ru/

Концепцией модернизации российского образования определены основные задачи профессионального образования: «подготовка квалифицированного работника соответствующего уровня и профиля, конкурентоспособного на рынке труда, компетентного, ответственного, свободно владеющего своей профессией и ориентированного в смежных областях деятельности, способного к эффективной работе по специальности на уровне мировых стандартов, готового к постоянному профессиональному росту, социальной и профессиональной мобильности; удовлетворение потребностей личности в получении соответствующего образования».
Решение этих задач невозможно без такого элемента обучения как самостоятельная работа студентов над учебным материалом. Однако, повысить качество самостоятельной работы можно только при ответственном отношении преподавателя за развитие навыков самостоятельной работы и повышение творческой активности студентов.
Самостоятельная работа студента является ключевой составляющей учебного процесса, которая определяет формирование навыков, умений и знаний, приемов познавательной деятельности и обеспечивает интерес к творческой работе.
Правильно спланированная и организованная самостоятельная работа студентов позволяет:
-сделать образовательный процесс более качественным и интенсивным;
-способствует созданию интереса к избранной профессии и овладению ее особенностями;
-приобщить студента к творческой деятельности;
-проводить в жизнь дифференцированный подход к обучению.
При организации самостоятельной работы студентов в качестве методологической основы должен применяться деятельный подход, когда обучение ориентировано на формирование умений решать не только типовые, но и нетиповые задачи, когда студент должен проявить творческую активность, инициативу, знания, умения и навыки, полученные при изучении конкретной дисциплины.
Формы самостоятельной работы студентов:
-конспектирование;
-реферирование литературы, аннотирование книг, статей;
-углубленный анализ научно-методической литературы;
-работа с лекционным материалом: проработка конспекта лекций, работа на полях конспекта с терминами, дополнение конспекта материалами из рекомендованной литературы;
-участие в работе семинара: подготовка сообщений, докладов, заданий;
-контрольная работа в письменном виде.

Виды самостоятельной работы:
-познавательная деятельность во время основных аудиторных занятий;
-внеаудиторная самостоятельная работа студентов по выполнению домашних заданий учебного и творческого характера (в том числе с электронными ресурсами);
-самостоятельное овладение студентами конкретных учебных модулей, предложенных для самостоятельного изучения;
-самостоятельная работа студентов по поиску материала, который может быть использован для написания рефератов, курсовых и квалификационных работ;
-самостоятельная работа во время прохождения практик.
Студенту, получившему задание на выполнение самостоятельной работы, следует рекомендовать:
1.Внимательно изучить материалы, характеризующие курс и тематику задания, прежде всего учебную литературу по дисциплине. Это позволит четко представить, как круг, изучаемых тем, так и глубину их постижения.
2. Составить подборку литературы, достаточную для изучения предлагаемых тем. В учебно-методическом комплексе представлены основной и дополнительные списки литературы. Они носят рекомендательный характер, это означает, что всегда есть литература, которая может не входить в данный список, но является необходимой для освоения темы. При этом следует иметь в виду, что нужна литература различных видов:
-учебники, учебные и учебно-методические пособия;
-первоисточники. К ним относятся оригинальные работы теоретиков, разрабатывающих проблемы.
-монографии, сборники научных статей, публикации в журналах, любой эмпирический материал;
-справочная литература - энциклопедии, словари, тематические, терминологические справочники, раскрывающие категориально-понятийный аппарат;
3.При изучении учебной литературы, раскрывающей основное содержание той или иной проблемы, понимать, что вопросы в истории любой науки трактовались многообразно. Это объясняется различиями в мировоззренческих позициях, на которых стояли авторы, а также свидетельствует об их сложности, позволяет выделить наиболее значимый аспект в данный исторический период. Кроме того, работа с учебником требует постоянного уточнения сущности и содержания категорий посредством обращения к энциклопедическим словарям и справочникам.
4.При осмыслении теоретических аспектов дисциплины помнить, что абсолютное большинство проблем носит не только теоретический характер, но самым непосредственным образом выходят на жизнь, они тесно связаны с практикой социального развития, преодоления противоречий и сложностей в обществе. Это предполагает наличие у студентов не только знания категорий и понятий, но и умения использовать их в качестве инструмента для анализа социальных проблем. Иными словами, студент должен предпринимать собственные интеллектуальные усилия, а не только механически заучивать понятия и положения.
5.Соотносить изученные закономерности с жизнью. Умение достигать аналитического знания предполагает у студента наличие мировоззренческой культуры. Формулирование выводов осуществляется, прежде всего, в процессе творческой дискуссии, протекающей с соблюдением методологических требований к процессу познания.
6. При поручении студентам самостоятельного задания необходимо предоставлять инструктаж по выполнению этого задания: цель задания; условия выполнения; объем; сроки; требования к оформлению.
* - все учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся размещаются в соответствии с действующим порядком на странице дисциплины на Учебном портале!

8. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ И БАЛЛЬНО-РЕЙТИНГОВАЯ СИСТЕМА ОЦЕНИВАНИЯ УРОВНЯ СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Оценочные материалы и балльно-рейтинговая система* оценивания уровня сформированности компетенций (части компетенций) по итогам освоения дисциплины «Системный анализ и менеджмент рисков» представлены в Приложении к настоящей Рабочей программе дисциплины.

* - ОМ и БРС формируются на основании требований соответствующего локального нормативного акта РУДН.