

Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования «Российский университет дружбы народов»

*Высшая школа промышленной политики и предпринимательства
факультет/институт*

Рекомендовано МССН

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Наименование дисциплины **Анализ рисков на основе больших данных**

Рекомендуется для направления подготовки/специальности

Направление подготовки: 38.04.01 «ЭКОНОМИКА»

Направленность программы (специализация)

«Принятие эффективных управленческих решений Big Data Economics»

Квалификация (степень) выпускника: Магистр

Москва, 2021

1.1. Программа курса «Анализ рисков на основе больших данных»

1. Цели и задачи дисциплины:

Целью изучения дисциплины «Анализ рисков на основе больших данных» является освоение знаний о науке и практике управления современной организацией.

Задачи дисциплины:

- приобретение студентами знаний теоретических основ управления организацией;
- овладение студентами основными понятиями, категориями, инструментами управленческой деятельности;
- освоение студентами эффективных приемов и форм управления и взаимодействия в процессе управления;
- умение практически использовать полученные знания для участия в управлении организации и принятия управленческих решений.

2. Место дисциплины в структуре ОП ВО:

Дисциплина «Анализ рисков на основе больших данных» относится к вариативной части блока 1 учебного плана (Б1.О.02.15).

В таблице № 1 приведены предшествующие и последующие дисциплины, направленные на формирование компетенций дисциплины в соответствии с матрицей компетенций ОП ВО.

Таблица № 1

Предшествующие и последующие дисциплины, направленные на формирование компетенций

№ п/п	Шифр и наименование компетенции	Предшествующие дисциплины	Последующие дисциплины (группы дисциплин)
Универсальные компетенции			
1	Способен осуществлять поиск, критический анализ и синтез информации, применять системный подход для решения поставленных задач (УК-1)	Организационное поведение Основы менеджмента Теория управления	Преддипломная практика
Общепрофессиональные компетенции			
2	Способен решать профессиональные задачи на основе знания (на промежуточном уровне) экономической, организационной и управленческой теории (ОПК-1)	Маркетинг Экономика предприятия	Преддипломная практика
Профессиональные компетенции (вид профессиональной деятельности <u>менеджмент</u>)			
3	Способность осуществлять организационно-управленческую деятельность в качестве линейного или функционального руководителя в	Управление изменениями	Преддипломная практика

	подразделениях организации (ПКО-2)		
--	---------------------------------------	--	--

3. Требования к результатам освоения дисциплины:

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

а) универсальных (УК):

- способен осуществлять поиск, критический анализ и синтез информации, применять системный подход для решения поставленных задач (УК-1);

б) общепрофессиональных (ОПК):

- способен решать профессиональные задачи на основе знания (на промежуточном уровне) экономической, организационной и управленческой теории (ОПК-1);

в) профессиональных (ПКО):

- способность осуществлять организационно-управленческую деятельность в качестве линейного или функционального руководителя в подразделениях организации (ПКО-2).

В результате изучения дисциплины студент должен:

Знать:

- основные этапы развития менеджмента как науки;
- содержание и основные функции менеджмента
- принципы развития и закономерности функционирования организации;
- роли, функции и задачи менеджера в современной организации;
- основные бизнес-процессы в организации;
- методы управления конфликтами;
- принципы разработки и методы принятия управленческих решений;
- информационное обеспечение менеджмента;
- роль лидера в современном менеджменте, основные теории и концепции лидерства;
- принципы формирования и поддержания управленческой культуры.

Уметь:

- анализировать внутреннюю и внешнюю среду организации для выявления ее ключевых элементов воздействия на организацию;
- ставить цели и формулировать задачи, связанные с осуществлением функций менеджмента;
- разрабатывать стратегический и тактический планы;
- проектировать организационную структуру с учетом поставленных целей;
- осуществлять распределение полномочий и ответственности на основе их делегирования;
- использовать мотивацию для более эффективного управления организацией;
- подготавливать организационно-управленческие решения, оценивать их последствия и риски;
- применять методы менеджмента, адекватные конкретной ситуации.

Владеть:

- методами реализации основных управленческих функций;
- методами целеполагания и разработки планов и заданий;
- понимание основных мотивов и механизмов принятия управленческих решений;
- методами информационной поддержки принятия управленческих решений;
- навыками организации деловой коммуникации;
- методами предотвращения конфликтных ситуаций;
- навыками самостоятельной работы.

4. Объем дисциплины и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет _____3_____ зачетных единицы.

Вид учебной работы	Всего часов	Семестры			
		1/1	1/2	-	-
Аудиторные занятия (всего)	42	18	24		
В том числе:	-	-	-	-	-
Лекции (Л)	17	9	8		
Семинары (С)	25	9	16		
Интерактивные занятия (ИЗ)	4	4	4		
Самостоятельная работа студентов (СРС)	17	9	8		
Вид промежуточной аттестации (зачет, экзамен)	49		49		
Общая трудоемкость 72 часа, 3 зач. ед.	108	36	72		

5. Содержание дисциплины

5.1. Содержание разделов дисциплины

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела
1	Понятие «Риск». Статический и динамический подход к анализу риска	<i>Природа происхождения риска: факторы риска, признаки и характеристики рисков производственной и наукоемкой деятельности. Методы анализа рисков и его оценки. Влияние внешней и внутренней среды на величину и степень сложности риска. Необходимость управления риском как движущим фактором экономического развития и конкурентоспособности предприятия, обеспечения финансово-экономической безопасности.</i>
2	Определение приемлемого уровня риска (риск-аппетита) при реализации производственных функций предприятия.	<i>Роль исполнительного органа предприятия в определении уровня риск-аппетита. Структура системы внутреннего контроля и риск-менеджмента на предприятии: функциональные обязанности и уровень ответственности за принятые решения.</i>
3	Выбор стратегии управления риском.	<i>Изучение Международных Стандартов внутреннего аудита и риск-менеджмента, стандартов и положений МФ РФ и ЦБ РФ. Миссия риск-менеджмента: определение целей и постановка задач. Факторы, влияющие на выбор стратегии управления риском: анализ внешней и внутренней среды. Распределение функций и</i>

		<i>организация операционной деятельности; разработка системы контроля и непрерывности процесса.</i>
4	Структура интегрированного Риск-менеджмента на предприятии.	<p><i>Система контроля уровня риска, функции и обязанности сотрудников предприятия в управлении риском – подчиненность и отчетность. Изучение различных моделей системы управления риском, анализ преимуществ и недостатков. Взаимосвязь между целями организации и компонентами процесса управления рисками.</i></p> <p><i>Динамическая модель управления риском: варианты построения структуры, позволяющей максимально эффективно реагировать на возникающие угрозы и эффективно управлять рисковым потоком на предприятии.</i></p>
5	Количественный анализ рисков.	<p><i>Основные виды количественного анализа: Оценка доходности, кривые рыночных доходностей, дюрация финансовых инструментов, вероятностное пространство.</i></p> <p><i>Модели количественного анализа – их преимущества и недостатки.</i></p>
6	Инструменты управления рисками предприятия и инновационных проектов в процессе их реализации. Финансовые инструменты. Страхование в системе риск- менеджмента.	<p><i>Страховое дело: история развития, виды страховой защиты.</i></p> <p><i>Современное страхование: тенденции усиления роли страхования как действенного инструмента управления рисками.</i></p> <p><i>Страхование крупного бизнеса и наукоемких производств в России: проблемы и пути их решения.</i></p> <p><i>Страховая математика: расчет страхового риска как основы для определения тарифа.</i></p> <p><i>Понятие «форс-мажор».</i></p> <p><i>Управление нестраховыми рисками. Риски, не подлежащие страхованию, имеют очень высокую кумуляцию (степень губительного воздействия) и катастрофические последствия. Характеристики нестраховых рисков: политические, операционные, риски потери репутации, информационные. Особенности управления нестраховыми рисками.</i></p> <p><i>Нефинансовые риски – риски, реализация которых не приводит к прямым финансовым потерям, но оказывающие существенное влияние на деятельность и</i></p>

		деловую репутацию предприятия. Социальный аспект нефинансовых рисков. Информационная безопасность – основа жизнедеятельности предприятия.
7	Значение риск-менеджмента для развития народного хозяйства России	<p>Понятие «национальный суверенитет» и влияние внешнего и внутреннего рискового потока на экономическую и политическую целостность государства. Риск как категория, отражающая меру опасности ситуаций, в которых имеются потенциальные факторы, способные неблагоприятно воздействовать на человека, организацию, общество, техносферу, окружающую среду, затруднить достижение поставленных целей, привести к приемлемому или неприемлемому ущербу.</p> <p>Новый (динамический) подход к управлению риском и его кардинальные отличия от традиционного подхода. Возможности перестройки структуры и алгоритмов управления риском на основе получения апостериорной информации и вычисления условных вероятностей событий (теорема Байеса). Творческое использование элемента неопределенности для выбора решения и действия, которое приводит к преимуществу перед конкурентами, к получению добавочного (предпринимательского) дохода.</p> <p>Управление рисками и безопасность. Задачи по управлению рисками в производственно-хозяйственной деятельности, одновременно обеспечивающие необходимую или максимальную безопасность предприятия.</p>

5.2. Разделы дисциплин и виды занятий

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Л	ПЗ	ИЗ	С	СРС	Всего час.
1.	Понятие «Риск». Статический и динамический подход к анализу риска	4	-	-	5	8	16
2.	Определение приемлемого уровня риска (риск-аппетита) при реализации производственных функций предприятия.	4	-	-	5	8	16
3.	Выбор стратегии управления риском	4	-	-	5	10	16
4.	Структура интегрированного Риск- менеджмента на предприятии	2			5	4	8

5.	Количественный анализ рисков.	3	-	4	5	6	16
6.	Контроль						49
7.	Итого	1 7			2 5	17	108

8. Практические занятия (семинары) *(при наличии)*

9.

№ п/п	№ раздела дисциплины	Тематика практических занятий (семинаров)	Трудо-емкость (час.)
1.	1	Организация корпоративной системы риск-менеджмента на предприятиях наукоемких отраслей экономики на примере(предприятия)	5
2.	2.	Инструменты оценки рисков с использованием технологии BDS	5
3	3.	Оценка уровня риск-аппетита	5
4	4.	Управление репутационными рисками	5
5	5.	Международные стандарты, практические рекомендации, аналитика и статистика по типам рисков.	5

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины:

(описывается материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)).

№ п.п	Фактический адрес учебных кабинетов и объектов	Перечень основного оборудования
1	Миклухо-Маклая, б, ком.19	21 рабочее место: сист.блок P4 C2D/3160 MHz MB/ 320 GB/DVD±RW/ LCD monitor 19"+ 1 проектор
2	Миклухо-Маклая, б, ком.21	21 рабочее место: сист.блок Celeron /2600 MHz/1280 MB/ 40 GB/DVD ROM/ LCD monitor 17"+ 1 проектор + Точка доступа WiFi
3	Миклухо-Маклая, б, ком.23	21 рабочее место: сист.блок Celeron /2660 MHz/1280 MB/ 40 GB/DVD ROM/ LCD monitor 17" + 1 проектор
4	Миклухо-Маклая, б, ком.25	21 рабочее место: сист.блок P4 /1700 MHz/1280 MB/ 40 GB/DVD ROM/ LCD monitor 17"+ 1 проектор
5	Миклухо-Маклая, б, ком.300	15 рабочих мест: сист.блок P4 C2D /2000 MHz/1024 MB/ 160 GB/DVD±RW/ LCD monitor 17" + 1 проектор

6	Миклухо-Маклая, 6, ком.17	1 проектор
7	Миклухо-Маклая, 6, ком.27	1 проектор, Точка доступа WiFi
8	Миклухо-Маклая, 6, ком.29	1 проектор
9	Миклухо-Маклая, 6, ком.101	1 проектор
10	Миклухо-Маклая, 6, ком.103	1 проектор
11	Миклухо-Маклая, 6, ком.105	1 проектор, Точка доступа WiFi
12	Миклухо-Маклая, 6, ком.107	1 проектор
13	Миклухо-Маклая, 6, КЗ	1 проектор, Точка доступа WiFi
14	Миклухо-Маклая, 6, читальный зал	1 проектор

9. Информационное обеспечение дисциплины

(указывается перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости))

а) программное обеспечение

MS Office (MS Word, MS Excel, Power Point и т.п.), Internet

б) базы данных, информационно-справочные и поисковые системы

<http://www.consultant.ru/> - справочно-поисковая система «Консультант+»

<http://www.garant.ru/> - информационно-правовой портал – источник информации об изменениях российского хозяйственного законодательства

<http://www.elibrary.ru/> - Научная электронная библиотек – крупнейший информационно-аналитический портал в области науки, технологии, медицины и образования

<http://www.gsk.ru/> - Федеральной службы государственной статистики РФ

<http://diss.rsl.ru/> - Электронная библиотека диссертаций РГБ

<http://www.iea.ru/> - Институт экономического анализа

<http://economist.rudn.ru> портал РУДН Economist

10. Учебно-методическое обеспечение дисциплины:

а) основная литература:

1. Варфоломеев В.П. Управление высокотехнологичным производством. – М.: Экономика, 2009. –296 с.

2. Полковский Л.М. Экономический анализ.- Экономика и финансы, 2002.

3. Внутренний аудит: Учебное пособие/под редакцией Ж.А. Кеворской.- М.:ЮНИТИ-ДАНА, 2014.-319 с.

4. Внутренний аудит и контроль финансово-хозяйственной деятельности: Практик. пособие / А.В. Евдокимова, И.Н. Пашкина. М.: Дашков и К, 2009

5. Управление финансами наукоемких предприятий: учебник./Под ред. Е.В. Соколова. – М.: Изд-во МГТУ им.Н.Э.Баумана,2008. –523с.

6. Цыганков В. А. Система управления наукоемким производством: учебное пособие. – Омск: Изд-во ОмГТУ, 2010. – 88 с.

б) дополнительная литература

7. COSO. Internal Control - Integrated Framework. Executive Summary. May 2013.

8. COSO. Internal Control - Integrated Framework. Framework and Appendices. May 2013.

9. COSO. Internal Control - Integrated Framework. Illustrative Tools for Assessing Effectiveness of a System of Internal Control. May 2013.
10. Internal Audit Capability Model (IA-CM) for the Public Sector / The IIA Research Foundation. 2013.
11. Internal Audit Reengineering: Survey, Model, and Best Practices, By P. Gupta / The IIA Research Foundation 2013.
12. Внутренний аудит: современный подход, Сонин А. / «Финансы и статистика» 2012.
13. Контроль и аудит, Терехов А., Терехов М. / «Финансы и статистика» 2012.
14. Внутренний контроль в коммерческой организации (организация, методика, практика), Соколов Б.Н. / «РОФЭР» 2011.
15. Международные стандарты аудита. Кодекс этики международной федерации бухгалтеров / МЦРСБУ 2011.
16. Организация работы комитета совета директоров по аудиту: Руководство для российских компаний, под общ. ред. А.Сониной / «Альпина Бизнес Букс» 2010.
17. В.В. Бурцев. Организация системы внутреннего контроля коммерческой организации. – М.: «Экзамен», 2000.
18. В.В. Ильюк. Управление конкурентоспособностью работников организации на основе развития системы внутреннего контроля. Монография. М.: 2012 год.
19. Управление рисками организаций. Свод общих положений. Методы применений. Ричард М. Стейнберг, Фрэнк Дж.Мартенс, Майл И.А. Эверсон, Люси И.Ноттингэм. 2009.
20. Управление рисками организаций. Интегрированная модель. Концептуальные основы. Джон Джей, Тони Маки.
21. Экономика космической деятельности. Ванюрихин Г.И., Давыдов В.А., Ковков Дж.В., Макаров Ю.Н., Пайсон Д.Б., Райкунов Г.Г., Чурсин А.А./Под научн. ред. проф. Райкунова Г.Г. – М.:ФИЗМАТЛИЗ,2013.-600с.
22. Ванюрихин Г.И. Креативный менеджмент.-М.:МГУ им. М.В. Ломоносова, 2007.-148 с.

11. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

Методические указания по оформлению рефератов.

Структура реферата

Структурными элементами реферата являются:

- 1) титульный лист;
- 2) оглавление;
- 3) введение;
- 4) основная часть;
- 5) заключение;
- 6) список использованных источников;
- 7) приложения.

Требования к структурным элементам реферата

Титульный лист

Титульный лист является первой страницей реферата, служит источником информации, необходимой для обработки и поиска документа.

На титульном листе приводят следующие сведения:

- 1) наименование ВУЗа;
- 2) наименование факультета;
- 3) наименование кафедры;
- 4) тема реферата;
- 5) фамилия и инициалы студента (слушателя);
- 6) должность, ученая степень, ученое звание, фамилия и инициалы руководителя реферата;

7) место и дата составления реферата.

Оглавление

Содержание оглавления включает введение, наименование всех глав, разделов, подразделов, пунктов (если они имеют наименование) и заключение с указанием номеров страниц, с которых начинаются эти элементы реферата.

Введение

Введение должно содержать оценку современного состояния решаемой проблемы. Во введении должны быть показаны актуальность темы, цели и задачи, которые будут рассматриваться в реферате, а также методы, которыми воспользовался студент (слушатель) для рассмотрения данной темы работы.

Во введении должны быть указаны структура работы и литературные источники, используемые автором в работе.

Основная часть

Основную часть реферата следует делить на главы или разделы. Разделы основной части могут делиться на пункты и подразделы. Пункты, при необходимости, могут делиться на подпункты. Каждый пункт должен содержать законченную информацию.

Заключение

Заключение должно содержать:

- выводы по результатам выполненной работы;
- список использованных источников.

Сведения об источниках приводятся в соответствии с требованиями ГОСТ 7.1. - 2003

Приложения

В приложения рекомендуется включать материалы, связанные с выполненной работой, которые по каким-либо причинам не могут быть включены в основную часть.

В приложения могут быть включены:

- 1) материалы, дополняющие реферат;
- 2) таблицы вспомогательных цифровых данных;
- 3) иллюстрации вспомогательного характера;
- 4) другие документы.

Правила оформления реферата

Общие требования

Страницы текста реферата, включенные в реферат приложения, таблицы и распечатки должны соответствовать формату А4 по ГОСТ 9327.

Реферат должен быть выполнен машинописным способом на одной стороне листа белой бумаги через полтора интервала и 14 шрифтом.

Текст реферата следует печатать, соблюдая следующие размеры полей: левое - не менее 30 мм, правое - не менее 10 мм, верхнее - не менее 15 мм, нижнее - не менее 20 мм. Текст выравнивается по ширине, переносы слов не допускаются.

Объем реферата: не более 20 страниц.

Все линии, буквы, цифры и знаки должны быть одинаково черными по всему реферату.

Заголовки структурных элементов реферата и разделов основной части следует располагать в середине строки без точки в конце и печатать прописными буквами, не подчеркивая.

Нумерация страниц

Страницы реферата следует нумеровать арабскими цифрами, соблюдая сквозную нумерацию по всему тексту отчета. Номер страницы проставляют посередине листа в верхнем поле без точки в конце.

Титульный лист включают в общую нумерацию страниц реферата. Номера страниц на титульном листе и в оглавлении не проставляют.

Нумерация рисунков и таблиц

Рисунки и таблицы, расположенные на отдельных листах, включают в общую нумерацию листов и помещают по возможности следом за листами, на которых приведены ссылки на эти таблицы или иллюстрации. Таблицы и иллюстрации нумеруются последовательно арабскими цифрами сквозной нумерацией. Допускается нумеровать рисунки и таблицы в пределах раздела. В этом случае номер таблицы (рисунка) состоит из номера раздела и порядкового номера таблицы, разделенных точкой.

Ссылки

Ссылки на источники следует указывать порядковым номером по списку источников, выделенным двумя косыми чертами.

Оформление ссылок - по ГОСТ 7.1.- 2003

Список использованных источников

Каждый источник должен содержать следующие обязательные реквизиты: фамилия и инициалы автора; наименование; издательство; место издания; год издания.

Все источники, включенные в библиографию, должны быть последовательно пронумерованы и расположены в следующем порядке: законодательные акты; постановления Правительства; нормативные документы; статистические материалы; научные и литературные источники – в алфавитном порядке по первой букве фамилии автора.

Приложения

Приложения размещаются в конце работы. В тексте на все приложения должны быть даны ссылки. Каждое приложение следует начинать с новой страницы с указанием наверху посередине страницы слова «Приложение» и его номера. Приложение должно иметь заголовок, который записывают симметрично относительно текста с прописной буквы отдельной строкой.

Подготовленная (сброшюрованная) работа сдается на кафедру для регистрации и последующей проверки преподавателем вместе с электронным вариантом.

12. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине (модулю)

Материалы для оценки уровня освоения учебного материала дисциплины «Маркетинг» (оценочные материалы), включающие в себя перечень компетенций с указанием этапов их формирования, описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания, типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы, методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций, разработаны в полном объеме и доступны для обучающихся на странице дисциплины в ТУИС РУДН.

Паспорт фонда оценочных средств по дисциплине «Анализ рисков на основе больших данных»

Код контролируемой компетенции или ее части	Контролируемый раздел дисциплины	Контролируемая тема дисциплины	ФОСы (формы контроля уровня освоения ООП)										Баллы темы	Баллы раздела	
			Аудиторная работа					Самостоятельная работа							
			Опрос	Тест	Коллоквиум	Контрольная работа	Дискуссия	Эссе	Выполнение ДЗ	Реферат	Творческий проект	Выполнение КР/КП			Экзамен/Зачет
УК-1,2 ОПК-1 ПКО-11,12	1. Понятие «Риск». Статический и динамический подход к анализу риска	1. Природа происхождения риска: факторы риска, признаки и характеристики рисков производственной и наукоемкой деятельности.	2						5					7	21
		2. Методы анализа рисков и его оценки. Влияние внешней и внутренней среды на величину и степень сложности риска.	2				5							7	
		3. Необходимость управления риском как движущим фактором экономического развития и конкурентоспособности предприятия, обеспечения финансово-экономической безопасности.	2						5					7	

		анализ внешней и внутренней среды.												
		5. Распределение функций и организация операционной деятельности; разработка системы контроля и непрерывности процесса.	2			5							7	
УК-1,2 ОПК-1 ПКО-11,12		Реферат								10				10
УК-1,2 ОПК-1 ПК-11,12		Рубежная аттестация (контрольная работа)			10									10
УК-1,2 ОПК-1		Тест		10										10
ПКО-11,12		Экзамен										20		20
		ИТОГО	25	10		10	10		15	10			20	100

Программа составлена в соответствии с требованиями ОС ВО РУДН.

Разработчики:

К.э.н., доцент кафедры прикладной экономики

Диесперова Н.А.

РУКОВОДИТЕЛЬ ПРОГРАММЫ

Зав. кафедрой Прикладной экономики, д.э.н., профессор



А.А. Чурсин