

# ЮЖНО-УРАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

УТВЕРЖДАЮ:  
Директор института  
Высшая школа экономики и  
управления

Электронный документ, подписанный ПГЭП, хранится в системе  
электронного документооборота  
ЮУрГУ  
Южно-Уральского государственного университета

СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПГЭП

Кому выдан: Карпушкина А. В.  
Пользователь: karpushkinaav  
Дата подписания: 08.02.2022

А. В. Карпушкина

## РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

**дисциплины 1.Ф.М1.14 Риск-менеджмент в проектах стратегического развития  
для направления 38.04.02 Менеджмент  
уровень Магистратура  
магистерская программа Стратегическое и корпоративное управление в условиях  
цифровой экономики  
форма обучения очная  
кафедра-разработчик Экономика и финансы**

Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению  
подготовки 38.04.02 Менеджмент, утверждённым приказом Минобрнауки от  
12.08.2020 № 952

Зав.кафедрой разработчика,  
д.экон.н., доц.

И. А. Соловьева

Электронный документ, подписанный ПГЭП, хранится в системе  
электронного документооборота  
Южно-Уральского государственного университета

СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПГЭП

Кому выдан: Соловьева И. А.  
Пользователь: solovevaia  
Дата подписания: 06.02.2022

Разработчик программы,  
д.экон.н., доц., профессор

И. А. Соловьева

Электронный документ, подписанный ПГЭП, хранится в системе  
электронного документооборота  
Южно-Уральского государственного университета

СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПГЭП

Кому выдан: Соловьева И. А.  
Пользователь: solovevaia  
Дата подписания: 06.02.2022

СОГЛАСОВАНО

Руководитель образовательной  
программы  
д.экон.н., проф.

Е. Д. Вайсман

Электронный документ, подписанный ПГЭП, хранится в системе  
электронного документооборота  
Южно-Уральского государственного университета

СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПГЭП

Кому выдан: Вайсман Е. Д.  
Пользователь: vaysmanned  
Дата подписания: 07.02.2022

Челябинск

## **1. Цели и задачи дисциплины**

Цель изучения дисциплины сформировать понимание корпоративного подхода в управлении рисками на примере реализации консалтинговых проектов Задачи изучения дисциплины 1. изучение основных подходов и методов анализа рисков 2. освоение навыков количественного и качественного анализа рисков 3. выработка у студентов умений разрабатывать конкретные управленческие решений в области управления рисками отдельных проектов и предприятия в целом

## **Краткое содержание дисциплины**

Изучение природы риска, классификации, методов управления рисковыми ситуациями, анализ отличия стандартного и корпоративного подходов к организации риск-менеджмента на предприятии

## **2. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины**

Планируемые результаты освоения ОП ВО (компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине
УК-2 Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	Знает: основы риск-менеджмента, типы стратегий развития, теорию жизненного цикла, теорию управления проектами Умеет: распознать отдельные этапы жизненного цикла проекта, идентифицировать риски на каждой стадии проекта стратегического развития, использовать ключевые подходы к управлению реализацией каждой стадии проекта стратегического развития предприятия, включая систему управления рисками Имеет практический опыт: оценки рисков на отдельных стадиях жизненного цикла проекта стратегического развития предприятия
ПК-4 Способен анализировать и оценивать финансово-экономические риски, прогнозировать динамику основных финансово-экономических показателей, обосновывать, развивать и поддерживать системы управления рисками на региональном, национальном и отраслевом уровнях	Знает: риск-менеджмент и его инструменты и методы, методы прогнозирования технико-экономических показателей деятельности организаций, подходы к разработке системы управления рисками на региональном, национальном и отраслевом уровнях Умеет: проводить оценку и анализ финансово-экономических рисков, анализировать ключевые финансово-экономические показатели и осуществлять их прогнозирование, формулировать предложения по разработке системы управления рисками на региональном, национальном и отраслевом уровнях Имеет практический опыт: анализа финансово-экономических рисков, анализа и прогнозирования технико-экономических показателей; оценки рисков на региональном, национальном и отраслевом уровнях
ПК-5 Способен разрабатывать финансовую политику и стратегию развития организаций,	Знает: методологию риск-менеджмента в проектах стратегического развития, содержание

<p>планировать, организовывать и внедрять проектные решения по управлению рисками, формировать дорожные карты, ключевые индикаторы, обосновывать мероприятия по минимизации рисков для различных сфер и направлений деятельности организации в условиях действующей институциональной среды</p>	<p>финансовой политики и стратегии развития организации, подходы к разработке дорожных карт и выбора индикаторов риска, основы институционализма и методы оценки текущих институтов, подходы к разработке мероприятий по минимизации рисков стратегического развития</p> <p>Умеет: формировать дорожные карты по снижению рисков в проектах стратегического развития организаций различных сфер и направлений деятельности в условиях сложившейся институциональной среды</p> <p>Имеет практический опыт: разработки проектов стратегического развития, включая разделы по управлению рисками</p>
---	---

### 3. Место дисциплины в структуре ОП ВО

Перечень предшествующих дисциплин, видов работ учебного плана	Перечень последующих дисциплин, видов работ
Построение системы управления рисками в организации	Не предусмотрены

Требования к «входным» знаниям, умениям, навыкам студента, необходимым при освоении данной дисциплины и приобретенным в результате освоения предшествующих дисциплин:

Дисциплина	Требования
Построение системы управления рисками в организации	<p>знать суть финансовой политики и стратегии развития организации, виды рисков для различных сфер и направлений деятельности предприятия, индикаторы этих рисков, модели раннего предупреждения рисков, методы разработки дорожных карт и комплекса мероприятий по предупреждению и снижению экономических последствий наступления рисковых событий уметь разработать основу системы управления рисками, для различных сфер и направлений деятельности предприятия, включая выбор индикаторов рисков и модели раннего предупреждения, формирование целей управления, разработку дорожных карт и комплекса мероприятий по предупреждению и снижению экономических последствий наступления рисковых событий</p>

### 4. Объём и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 з.е., 108 ч., 56,5 ч. контактной работы

Вид учебной работы	Всего	Распределение по семестрам
--------------------	-------	----------------------------

	часов	в часах	
		Номер семестра	
		4	
Общая трудоёмкость дисциплины	108	108	
<i>Аудиторные занятия:</i>	48	48	
Лекции (Л)	12	12	
Практические занятия, семинары и (или) другие виды аудиторных занятий (ПЗ)	36	36	
Лабораторные работы (ЛР)	0	0	
<i>Самостоятельная работа (СРС)</i>	51,5	51,5	
с применением дистанционных образовательных технологий	0		
Решение кейсов	35,5	35,5	
Подготовка к экзамену	16	16	
Консультации и промежуточная аттестация	8,5	8,5	
Вид контроля (зачет, диф.зачет, экзамен)	-	экзамен	

## 5. Содержание дисциплины

№ раздела	Наименование разделов дисциплины	Объем аудиторных занятий по видам в часах			
		Всего	Л	ПЗ	ЛР
1	Понятие и виды риска	8	2	6	0
2	Методы оценки, анализа и управления рисками	14	4	10	0
3	Корпоративный подход к управлению рисками	14	2	12	0
4	Организация риск-менеджмента на предприятии	12	4	8	0

### 5.1. Лекции

№ лекции	№ раздела	Наименование или краткое содержание лекционного занятия	Кол-во часов
1	1	Подходы к определению категории риска. Классификация рисков. Исторические подходы к управлению риском	2
2,3	2	Методы оценки, анализа и управления рисками	4
4	3	Управление рисками на предприятии. Комплексный анализ рисков. Разработка управленческих решений по снижению рисков	2
5,6	4	Организация риск-менеджмента на предприятии	4

### 5.2. Практические занятия, семинары

№ занятия	№ раздела	Наименование или краткое содержание практического занятия, семинара	Кол-во часов
1,2,3	1	Выявление и классификация рисков предприятия. Разбор конкретных ситуаций	4
4	1	Решение кейса на идентификацию рисков	2
5,6,7	2	Решение задач на оценку и анализ рисков различными методами	4
8,9,10	2	Управление рисками. Решение кейсов	6
11,12,13	3	Комплексное управление рисками. Разработка комплексной программы	6

		оценки и анализа рисков для конкретного предприятия	
14, 15,16	3	Разработка управленческих решений по снижению рисков. Решение кейсов	6
17,18,19	4	Организация риск-менеджмента на предприятии. анализ конкретных ситуаций	4
20, 21	4	Разработка макета регламента управления рисками на предприятии	4

### 5.3. Лабораторные работы

Не предусмотрены

### 5.4. Самостоятельная работа студента

Выполнение СРС			
Подвид СРС	Список литературы (с указанием разделов, глав, страниц) / ссылка на ресурс	Семестр	Кол-во часов
Решение кейсов	Дамодаран, А. Инвестиционная оценка: Инструменты и методы оценки любых активов А. Дамодаран; Пер. с англ. Д. Липинского и др. - 2-е изд., испр. - М.: Альпина Бизнес Букс, 2005. - XVI,1323 с.	4	35,5
Подготовка к экзамену	Дамодаран, А. Инвестиционная оценка: Инструменты и методы оценки любых активов А. Дамодаран; Пер. с англ. Д. Липинского и др. - 2-е изд., испр. - М.: Альпина Бизнес Букс, 2005. - XVI,1323 с.	4	16

## 6. Текущий контроль успеваемости, промежуточная аттестация

Контроль качества освоения образовательной программы осуществляется в соответствии с Положением о балльно-рейтинговой системе оценивания результатов учебной деятельности обучающихся.

### 6.1. Контрольные мероприятия (КМ)

№ КМ	Се- местр	Вид контроля	Название контрольного мероприятия	Вес	Макс. балл	Порядок начисления баллов	Учи- тыва- ется в ПА
1	4	Текущий контроль	Практикум по разделу 1	1	15	Студенту в рамках практикума необходимо решить 5 задач Каждая задача оценивается в 3 балла 3 балла - полностью корректное решение 2 балла - решение с небольшими расчетными ошибками 1 балл - решение с грубыми ошибками 0 баллов - отсутствует решение	экзамен
2	4	Текущий контроль	тестирование	1	20	Количество вопросов, формируемых компьютером самостоятельно - 20 Время, отводимое на тестирование 40 минут. При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система	экзамен

						оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179) Правильный ответ на вопрос соответствует 1 баллу. Неправильный ответ на вопрос соответствует 0 баллов. Максимальное количество баллов - 20	
3	4	Текущий контроль	Решение кейса	1	15	В рамках решения кейса предлагается построить финансовую модель и оценить эффективность проекта 0 баллов - решение кейса отсутствует 5 баллов - выполнены необходимые расчеты, выводы по кейсу или не сформулированы вообще или не по всем вопросам кейса 10 баллов - выполнены необходимые расчеты, сформулированы выводы. не все расчеты и выводы полностью корректны 15 баллов - выполнены все необходимые расчеты, сформулированы полностью корректные выводы по всем поставленным в кейсе вопросам	экзамен
4	4	Текущий контроль	Решение кейса	1	15	В рамках решения кейса необходимо оценить риски методами анализа чувствительности и методом операционного анализа 0 баллов - решение кейса отсутствует 5 баллов - выполнены необходимые расчеты, выводы по кейсу или не сформулированы вообще или не по всем вопросам кейса 10 баллов - выполнены необходимые расчеты, сформулированы выводы. не все расчеты и выводы полностью корректны 15 баллов - выполнены все необходимые расчеты, сформулированы полностью корректные выводы по всем поставленным в кейсе вопросам	экзамен
5	4	Текущий контроль	Решение кейса	1	15	В рамках решения кейса необходимо оценить риски методом сценарного анализа и разработать рекомендации по управлению рисками с построением дорожной карты 0 баллов - решение кейса отсутствует 5 баллов - выполнены необходимые расчеты, выводы по кейсу или не сформулированы вообще или не по всем вопросам кейса 10 баллов - выполнены необходимые расчеты, сформулированы выводы. не все расчеты и выводы полностью корректны 15 баллов - выполнены все необходимые расчеты, сформулированы полностью корректные выводы по всем поставленным в кейсе вопросам	экзамен
6	4	Проме-	тестирование	-	30		экзамен

		журнальная аттестация			В тесте 30 вопросов Правильный ответ на вопрос соответствует 1 баллу. Неправильный ответ на вопрос - 0 баллов	
--	--	-----------------------	--	--	--	--

## 6.2. Процедура проведения, критерии оценивания

Вид промежуточной аттестации	Процедура проведения	Критерии оценивания
экзамен	Экзамен проходит в форме тестирования. в тесте 30 вопросов теоретического и расчетного характера. На тест отводится 1,5 часа. правильный ответ на тестовый вопрос - 1 балл. неправильный - 0 баллов. При выставлении оценки за экзамен учитывается результат прохождения студентом контрольных мероприятий текущего контроля и промежуточной аттестации. Оценка "Отлично" выставляется если рейтинг студента выше 85%, оценка "Хорошо" - если рейтинг студента от 75 до 84%, оценка "удовлетворительно" - если рейтинг студента от 60 до 74%, оценка "неудовлетворительно", если рейтинг студента ниже 60%.	В соответствии с пп. 2.5, 2.6 Положения

## 6.3. Оценочные материалы

Компетенции	Результаты обучения	№ КМ					
		1	2	3	4	5	6
УК-2	Знает: основы риск-менеджмента, типы стратегий развития, теорию жизненного цикла, теорию управления проектами	+					+
УК-2	Умеет: распознать отдельные этапы жизненного цикла проекта, идентифицировать риски на каждой стадии проекта стратегического развития, использовать ключевые подходы к управлению реализацией каждой стадии проекта стратегического развития предприятия, включая систему управления рисками	+			++		
УК-2	Имеет практический опыт: оценки рисков на отдельных стадиях жизненного цикла проекта стратегического развития предприятия					+++	
ПК-4	Знает: риск-менеджмент и его инструменты и методы, методы прогнозирования технико-экономических показателей деятельности организаций, подходы к разработке системы управления рисками на региональном, национальном и отраслевом уровнях	+					+
ПК-4	Умеет: проводить оценку и анализ финансово-экономических рисков, анализировать ключевые финансово-экономические показатели и осуществлять их прогнозирование, формулировать предложения по разработке системы управления рисками на региональном, национальном и отраслевом уровнях	+				++++	
ПК-4	Имеет практический опыт: анализа финансово-экономических рисков, анализа и прогнозирования технико-экономических показателей; оценки рисков на региональном, национальном и отраслевом уровнях					+++++	
ПК-5	Знает: методологию риск-менеджмента в проектах стратегического развития, содержание финансовой политики и стратегии развития организаций, подходы к разработке дорожных карт и выбора индикаторов риска, основы институционализма и методы оценки текущих институтов, подходы к разработке мероприятий по минимизации рисков стратегического развития	+					+
ПК-5	Умеет: формировать дорожные карты по снижению рисков в проектах						++

	стратегического развития организаций различных сфер и направлений деятельности в условиях сложившейся институциональной среды					
ПК-5	Имеет практический опыт: разработки проектов стратегического развития, включая разделы по управлению рисками		+	++		

Фонды оценочных средств по каждому контрольному мероприятию находятся в приложениях.

## 7. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

### Печатная учебно-методическая документация

#### a) основная литература:

1. Воробьев, С. Н. Управление рисками в предпринимательстве С. Н. Воробьев, К. В. Балдин. - М.: Дашков и К, 2005. - 769,[1] с.
2. Дамодаран, А. Инвестиционная оценка: Инструменты и методы оценки любых активов А. Дамодаран; Пер. с англ. Д. Липинского и др. - 2-е изд., испр. - М.: Альпина Бизнес Букс, 2005. - XVI,1323 с.

#### б) дополнительная литература:

1. Гончаренко, Л. П. Риск-менеджмент Текст учеб. пособие Л. П. Гончаренко, С. А. Филин ; под ред. Е. А. Олейникова ; Рос. экон. акад. им. Г. В. Плеханова. - 2-е изд., стер. - М.: КноРус, 2007

#### в) отечественные и зарубежные журналы по дисциплине, имеющиеся в библиотеке:

1. 1. Риск
2. 2. Управление рисками

#### г) методические указания для студентов по освоению дисциплины:

1. Методическое пособие для самостоятельной работы студента по дисциплине "Риск-менеджмент"

из них: учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студента:

1. Методическое пособие для самостоятельной работы студента по дисциплине "Риск-менеджмент"

### Электронная учебно-методическая документация

№	Вид литературы	Наименование ресурса в электронной форме	Библиографическое описание
1	Дополнительная литература	Образовательная платформа Юрайт	Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 365 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-3502-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт <a href="https://urait.ru/bcode/489098">https://urait.ru/bcode/489098</a>

Перечень используемого программного обеспечения:

1. ФГАОУ ВО "ЮУрГУ (НИУ)"-Портал "Электронный ЮУрГУ" (<https://edu.susu.ru>)(бессрочно)

Перечень используемых профессиональных баз данных и информационных справочных систем:

Нет

## 8. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Вид занятий	№ ауд.	Основное оборудование, стенды, макеты, компьютерная техника, предустановленное программное обеспечение, используемое для различных видов занятий
Самостоятельная работа студента	501 (1)	20 компьютеров
Экзамен	410 (1)	13 компьютеров, проектор
Лекции	312 (1)	компьютер, проектор
Практические занятия и семинары	312 (1)	компьютер, проектор