ЮЖНО-УРАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

УТВЕРЖДАЮ:
Директор института
Высшая школа экономики и управления

Электронный документ, подписанный ПЭП, хранится в системе электронного документооборота Южно-Уральского государственного университета
СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПЭП
Кому выдан: Карпушкина А. В.
Пользователь: karpushkinaav
Дата подписания: 09.03.2023

А. В. Карпушкина

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины В.1.16 Риск-менеджмент
для направления 38.03.01 Экономика
уровень бакалавр **тип программы** Академический бакалавриат
профиль подготовки Финансы и кредит
форма обучения заочная
кафедра-разработчик Экономика промышленности и управление проектами

Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, утверждённым приказом Минобрнауки от 12.11.2015 № 1327

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

Электронный документ, подписанный ПЭП, хранится в системе электронного документооборота Южно-Уральского государственного университета
СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПЭП
Кому выдан: Дзензелюк Н. С.
Пользователь: dzenzeliukns
Дата подписания: 05.03.2023

Н. С. Дзензелюк

Разработчик программы,
к.техн.н., доц., доцент

Электронный документ, подписанный ПЭП, хранится в системе электронного документооборота Южно-Уральского государственного университета
СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПЭП
Кому выдан: Матвеев Б. А.
Пользователь: matveevba
Дата подписания: 05.03.2023

Б. А. Матвеев

СОГЛАСОВАНО

Зав.выпускающей кафедрой
Экономика и финансы
д.экон.н., доц.

Электронный документ, подписанный ПЭП, хранится в системе электронного документооборота Южно-Уральского государственного университета
СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПЭП
Кому выдан: Соловьева И. А.
Пользователь: solovevaia
Дата подписания: 09.03.2023

И. А. Соловьева

Челябинск

1. Цели и задачи дисциплины

Основная цель дисциплины - сформировать комплексное представление о роли и содержании риск-менеджмента в экономике, методах анализа рисков и их учёта при принятии управленческих решений Основные задачи дисциплины: - сформировать систему знаний о сущности и роли экономических рисков; - изучить методы выявления и оценки рисков; - изучить методы воздействия на риск; - познакомить с системой управления экономическими рисками; - дать навыки принятия управленческих решений в условиях полной неопределённости и риска

Краткое содержание дисциплины

Система экономических рисков и их классификация. Оценка, анализ и управление экономическими рисками.

2. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины

Планируемые результаты освоения ОП ВО (компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине (ЗУНы)
ПК-5 способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений	Знать: методы анализа экономических рисков.
	Уметь: выявлять и оценивать экономические риски.
	Владеть: методами оценки риска.
ОПК-4 способностью находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовность нести за них ответственность	Знать: последствия воздействия риск-факторов на результаты деятельности хозяйствующего субъекта.
	Уметь: выбрать организационно-управленческое решение, оптимизирующее риски.
	Владеть: навыками принятия управленческих решений в рисковых ситуациях.

3. Место дисциплины в структуре ОП ВО

Перечень предшествующих дисциплин, видов работ учебного плана	Перечень последующих дисциплин, видов работ
Б.1.08 Микроэкономика, В.1.10 Экономическая статистика	Не предусмотрены

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

Дисциплина	Требования
Б.1.08 Микроэкономика	знать: закономерности функционирования организации; уметь: анализировать внешнюю и внутреннюю среду организации, оценивать влияние внутренних и внешних факторов на результаты хозяйственной деятельности;

	владеть: методами оценки воздействия внутренних и внешних факторов на функционирование организации
В.1.10 Экономическая статистика	Знать: основы построения статистических показателей Уметь: собирать, обрабатывать и анализировать статистические данные Владеть: методиками расчёта экономических показателей

4. Объём и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 з.е., 108 ч.

Вид учебной работы	Всего часов	Распределение по семестрам в часах
		Номер семестра
		9
Общая трудоёмкость дисциплины	108	108
Аудиторные занятия:	12	12
Лекции (Л)	8	8
Практические занятия, семинары и (или) другие виды аудиторных занятий (ПЗ)	4	4
Лабораторные работы (ЛР)	0	0
Самостоятельная работа (СРС)	96	96
Подготовка к экзамену. Выполнение контрольно-рейтинговых мероприятий текущего контроля	88	88
Подготовка к практическим занятиям	8	8
Вид итогового 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	Общие сведения об экономическом риске	2	2	0	0
2	Анализ и оценка экономических рисков	8	4	4	0
3	Управление экономическими рисками	2	2	0	0

5.1. Лекции

№ лекции	№ раздела	Наименование или краткое содержание лекционного занятия	Кол-во часов
1	1	Общие сведения об экономическом риске	2
2,3	2	Анализ и оценка экономических рисков	4
4	3	Управление экономическими рисками	2

5.2. Практические занятия, семинары

№ занятия	№ раздела	Наименование или краткое содержание практического занятия, семинара	Кол-во часов
1,2	2	Анализ и оценка экономических рисков	4

5.3. Лабораторные работы

Не предусмотрены

5.4. Самостоятельная работа студента

Выполнение СРС		
Вид работы и содержание задания	Список литературы (с указанием разделов, глав, страниц)	Кол-во часов
Подготовка к практическим занятиям	1. Матвеев Б.А. Риск-менеджмент [Электронный ресурс]: курс лекций / Б.А. Матвеев. - Челябинск: ЮУрГУ, 2022. - С. 3-179. 2. Матвеев Б.А. Управление рисками [Электронный ресурс]: курс лекций / Б.А. Матвеев. - Челябинск: ЮУрГУ, 2017. - С. 3-72. 3. Вяткин В.Н. Риск-менеджмент [Текст] учебник для вузов по экон. направлениям В.Н. Вяткин, В.А. Гамза, Ф.В. Маевский; Финанс. ун-т при Правительстве Рос. Федерации. - 2-е изд., перераб. и доп. - М.: Юрайт, 2017. - С. 5-365. 4. Маховикова, Г.А. Анализ и оценка рисков в бизнесе. - М.: Юрайт, 2014. - С. 6-464. 5. Фёдорова, Е.А. Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски. - М.: КНОРУС, 2010. - С. 90-176. 6. Малашихина, Н.Н. Риск-менеджмент. – Ростов н/Д: Феникс, 2007. – С. 118-17.1 7. Банковские риски: учебник / Под ред. О. И. Лаврушина. - М.: КНОРУС, 2016. - С. 5-289. 8. Моделирование рисковых ситуаций в экономике и бизнесе / Под ред. Лагоши. - М.: Финансы и статистика, 2009. - С. 11-207.	8
Подготовка к экзамену. Выполнение контрольно-рейтинговых мероприятий текущего контроля	Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины	88

6. Инновационные образовательные технологии, используемые в учебном процессе

Инновационные формы учебных занятий	Вид работы (Л, ПЗ, ЛР)	Краткое описание	Кол-во ауд. часов
Групповая дискуссия	Практические занятия и семинары	1. Задаётся тема с обозначением существующих проблем 2. Коллективно обсуждается конкретная проблема (анализируется конкретная ситуация) 3. Сопоставляются разные позиции, мнения, предложения, генерируются идеи 4. Вырабатывается единое или компромиссное решение	1

Собственные инновационные способы и методы, используемые в образовательном процессе

Не предусмотрены

Использование результатов научных исследований, проводимых университетом, в рамках данной дисциплины: Разработан спектральный метод оценки экономических рисков

7. Фонд оценочных средств (ФОС) для проведения текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины

7.1. Паспорт фонда оценочных средств

Наименование разделов дисциплины	Контролируемая компетенция ЗУНы	Вид контроля (включая текущий)	№№ заданий
Все разделы	ОПК-4 способностью находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовность нести за них ответственность	Экзамен	Вопросы: 5-8, 12, 13
Все разделы	ПК-5 способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений	Экзамен	Вопросы: 1-4, 9-11
Управление экономическими рисками	ОПК-4 способностью находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовность нести за них ответственность	Реферат	Темы: 8-10, 11, 12, 14, 15, 17, 18, 22-26, 28
Анализ и оценка экономических рисков	ПК-5 способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений	Реферат	Темы: 2, 3, 5-7, 16, 19-23, 25, 27
Все разделы	ПК-5 способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений	Тест	Вопросы: 1-85
Все разделы	ПК-5 способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений	Самостоятельная работа	Вопросы для исследования

Все разделы	ПК-5 способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений	Доклад	все

7.2. Виды контроля, процедуры проведения, критерии оценивания

Вид контроля	Процедуры проведения и оценивания	Критерии оценивания
Экзамен	На экзамене происходит оценивание результатов учебной деятельности обучающихся. Оценка по дисциплине формируется по результатам контрольно-рейтинговых мероприятий текущего контроля, если студента не устраивает рейтинг, то на экзамене он вправе повысить его, пройдя мероприятие промежуточной аттестации. На экзамене рейтинг по дисциплине R (средневзвешенное значение) складывается из текущего рейтинга T (его вес - 0,6) и рейтинга, полученного на экзамене E (его вес - 0,4): R = 0,6T + 0,4E. При оценивании результатов учебной деятельности обучающегося по дисциплине используется бально-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179). Мероприятие промежуточной аттестации не является обязательным и служит для повышения рейтинга студента. Мероприятие промежуточной аттестации проводится в устной форме по билетам. В билете - три вопроса. Время подготовки - 1 час. Критерии оценивания: 2 балла - студент обладает глубокими знаниями темы, легко отвечает на поставленный вопрос; 1 балл - студент не даёт исчерпывающий ответ на вопрос билета, показывает знание темы, отвечает на уточняющие вопросы; 0 баллов - студент затрудняется ответить на поставленный вопрос, показывает слабое знание темы, при ответе допускает существенные ошибки. Максимальное количество баллов - 6.	Отлично: Величина рейтинга обучающегося по дисциплине 85…100 % Хорошо: Величина рейтинга обучающегося по дисциплине 75…84 % Удовлетворительно: Величина рейтинга обучающегося по дисциплине 60…74 % Неудовлетворительно: Величина рейтинга обучающегося по дисциплине 0…59 %
Реферат	При оценивании результатов мероприятия используется бально-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179). Работа выполняется в электронном виде. Студент раскрывает тему реферата, анализирует материал, приводит источники информации, делает выводы. Показатели оценивания: 5 баллов: реферат имеет логичное, последовательное изложение материала с соответствующими выводами и обоснованными положениями; 4 балла: реферат имеет последовательное изложение материала, в нём	Отлично: величина рейтинга обучающегося за мероприятие 85...100 %. Хорошо: величина рейтинга обучающегося за мероприятие 75...84 %. Удовлетворительно: величина рейтинга обучающегося за мероприятие 60...74 %. Неудовлетворительно:

	представлен достаточно подробный анализ с соответствующими выводами, однако с не вполне обоснованными положениями; 3 балла: тема реферата раскрыта не полностью, реферат имеет поверхностный анализ, в нём просматривается непоследовательность изложения материала, представлены необоснованные положения; 0 баллов: тема реферата не раскрыта, реферат не имеет анализа, в работе нет выводов либо они имеют декларативный характер. Максимальное количество баллов - 5.	величина рейтинга обучающегося за мероприятие 0...59 %.
Тест	При оценивании результатов учебной деятельности обучающегося по дисциплине используется бально-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179). Задание выполняется в электронном виде. Тест содержит 10 заданий. На ответы отводится 30 мин. Показатели оценивания: правильный ответ на вопрос соответствует 1 баллу. неправильный ответ на вопрос соответствует 0 баллов. Максимальное количество баллов - 10.	Отлично: величина рейтинга обучающегося по дисциплине 85...100 %. Хорошо: величина рейтинга обучающегося по дисциплине 75...84 %. Удовлетворительно: величина рейтинга обучающегося по дисциплине 60...74 %. Неудовлетворительно: величина рейтинга обучающегося по дисциплине 0...59 %.
Самостоятельная работа	Студент самостоятельно выбирает предприятие (организацию), для которого анализируются риски и разрабатывается Программа мероприятий по их управлению. Результаты исследования оформляются в виде презентации. Показатели оценивания: Отлично (5 баллов) - содержание работы полностью отвечает предъявляемым требованиям; Хорошо (4 балла) - содержание работы по одному пункту не отвечает предъявляемым требованиям; Удовлетворительно (3 балла) - содержание работы по двум пунктам не отвечает предъявляемым требованиям; Неудовлетворительно (0 баллов) - содержание работы более, чем по двум пунктам не отвечает предъявляемым требованиям.	Отлично: величина рейтинга обучающегося за мероприятие 85...100 %. Хорошо: величина рейтинга обучающегося за мероприятие 75...84 %. Удовлетворительно: величина рейтинга обучающегося за мероприятие 60...74. Неудовлетворительно: величина рейтинга обучающегося за мероприятие 0...59 %.
Доклад	Тема доклада совпадает с темой самостоятельной работы. Студент по презентации, выполненной в ходе самостоятельной работы делает доклад. Показатели оценивания: Отлично (5 баллов) - студент показывает глубокое знание вопросов темы, свободно оперирует данными исследования, легко отвечает на поставленные вопросы; Хорошо (4 балла) - студент затрудняется ответить на некоторые поставленные вопросы; Удовлетворительно (3 балла) - студент показывает слабое знание вопросов темы, не всегда даёт аргументированные ответы на заданные вопросы; Неудовлетворительно (0 баллов) - студент затрудняется ответить на поставленные вопросы, не знает теории вопроса, при ответе допускает существенные ошибки	Отлично: Величина рейтинга обучающегося за мероприятие 85…100 % Хорошо: Величина рейтинга обучающегося за мероприятие 75…84 % Удовлетворительно: Величина рейтинга обучающегося за мероприятие 60…74 % Неудовлетворительно: Величина рейтинга обучающегося за мероприятие 0…59 %

7.3. Типовые контрольные задания

Вид контроля	Типовые контрольные задания
Экзамен	Вопросы для подготовки к экзамену ФОС Вопросы к экзамену.pdf; Вопросы к экзамену.pdf
Реферат	Темы рефератов.pdf
Тест	Вопросы теста.pdf
Самостоятельная работа	Требования к содержанию работы.pdf
Доклад	

8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

Печатная учебно-методическая документация

а) основная литература:

1. Балдин, К. В. Управление рисками [Текст] учеб. пособие для вузов по специальностям экономики и упр. (060000) К. В. Балдин, С. Н. Воробьев. - М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2005. - 511 с. ил.
2. Воробьев, С. Н. Управление рисками в предпринимательстве [Текст] С. Н. Воробьев, К. В. Балдин. - 4-е изд., испр. - М.: Дашков и К, 2011. - 480, [1] с. ил.
3. Чернова, Г. В. Управление рисками [Текст] учеб. пособие по специальностям "Финансы и кредит" и др. Г. В. Чернова, А. А. Кудрявцев. - М.: Проспект, 2007. - 158 с. ил.
4. Ступаков, В. С. Риск-менеджмент [Текст] учеб. пособие по специальности "Финансы и кредит" В. С. Ступаков, Г. С. Токаренко. - М.: Финансы и статистика, 2007. - 281, [1] с. ил.
5. Козлова, Е. А. Управление риском инвестиционных проектов [Текст] учеб. пособие Е. А. Козлова ; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Экономика, упр. и инвестиции ; ЮУрГУ. - Челябинск: Издательство ЮУрГУ, 2005. - 94, [1] с. ил.

б) дополнительная литература:

1. Балдин, К. В. Риск-менеджмент [Текст] учеб. пособие для вузов по специальности "Менеджмент организаций" К. В. Балдин. - М.: ЭКСМО, 2006. - 364, [1] с. ил.
2. Лясковская, Е. А. Риск-менеджмент на российских предприятиях [Текст] учеб. пособие Е. А. Лясковская ; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Экономика, упр. и инвестиции ; ЮУрГУ. - Челябинск: Издательский Центр ЮУрГУ, 2011. - 74, [1] с. электрон. версия
3. Рогов, М. А. Риск-менеджмент [Текст] М. А. Рогов. - М.: Финансы и статистика, 2001. - 118,[1] с. ил.
4. Хохлов, Н. В. Управление риском [Текст] учеб. пособие для вузов Н. В. Хохлов. - М.: ЮНИТИ, 2001. - 238, [1] с.

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

1. Управление риском ежекв. журн. Фирма "Анкил" журнал. - М., 1997-

г) методические указания для студентов по освоению дисциплины:

1. Смирнова, И. В. Организация самостоятельной работы студентов: метод. указания [Электронный ресурс] / И.В. Смирнова. - Челябинск : Издательский Центр ЮУрГУ , 2018. - 17 с. - https://lib.susu.ru/ftd?base=SUSU_METHOD&key=000560202&dtype=F&etype=pdf

из них: учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студента:

1. Смирнова, И. В. Организация самостоятельной работы студентов: метод. указания [Электронный ресурс] / И.В. Смирнова. - Челябинск : Издательский Центр ЮУрГУ , 2018. - 17 с. - https://lib.susu.ru/ftd?base=SUSU_METHOD&key=000560202&dtype=F&etype=pdf

Электронная учебно-методическая документация

№	Вид литературы	Наименование ресурса в электронной форме	Библиографическое описание
1	Дополнительная литература	Электронный каталог ЮУрГУ	Матвеев Б.А. Управление рисками [Электронный ресурс]: курс лекций Матвеев. - Челябинск: ЮУрГУ, 2017. - 70 с. https://lib.susu.ru/ftd?base=SUSU_METHOD&key=000553255&dtype=F&
2	Основная литература	Электронный каталог ЮУрГУ	Матвеев Б.А. Риск-менеджмент [Электронный ресурс]: курс лекций / Б Матвеев. - Челябинск: ЮУрГУ, 2022. - 179 с. https://lib.susu.ru/ftd?base=SUSU_METHOD&key=000572149&dtype=F&

9. Информационные технологии, используемые при осуществлении образовательного процесса

Перечень используемого программного обеспечения:

1. Microsoft-Windows(бессрочно)
2. Microsoft-Office(бессрочно)
3. ФГАОУ ВО "ЮУрГУ (НИУ)"-Портал "Электронный ЮУрГУ" (https://edu.susu.ru)(бессрочно)

Перечень используемых информационных справочных систем:

1. -База данных ВИНИТИ РАН(бессрочно)

10. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Вид занятий	№ ауд.	Основное оборудование, стенды, макеты, компьютерная техника, предустановленное программное обеспечение, используемое для различных видов занятий
Контроль	256	Проектор, интерактивная доска, персональные компьютеры (13 штук),

самостоятельной работы	(2)	подключённые к сети Интернет и с доступом в информационную среду университета, специализированная мебель (13 компьютерных столов)
Экзамен	264 (2)	Проектор, ноутбук, интерактивная доска
Лекции	265 (3)	Проектор, ноутбук, интерактивная доска
Практические занятия и семинары	264 (2)	Проектор, ноутбук, интерактивная доска
Самостоятельная работа студента	256 (2)	Проектор, интерактивная доска, персональные компьютеры (13 штук), подключённые к сети Интернет и с доступом в информационную среду университета, специализированная мебель (13 компьютерных столов)
Пересдача	264 (2)	Проектор, ноутбук, интерактивная доска