ЮЖНО-УРАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

УТВЕРЖДАЮ:
Руководитель направления

Электронный документ, подписанный ПЭП, хранится в системе электронного документооборота Южно-Уральского государственного университета
ЮУрГУ
СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПЭП
Кому выдан: Карпушкина А. В.
Пользователь: karpushkinaav
Дата подписания: 17.02.2024

А. В. Карпушкина

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины 1.Ф.12 Риск-менеджмент
для направления 38.03.02 Менеджмент
уровень Бакалавриат
форма обучения очно-заочная
кафедра-разработчик Экономика промышленности и управление проектами

Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент, утверждённым приказом Минобрнауки от 12.08.2020 № 970

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

Электронный документ, подписанный ПЭП, хранится в системе электронного документооборота Южно-Уральского государственного университета
ЮУрГУ
СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПЭП
Кому выдан: Дзензелюк Н. С.
Пользователь: dzenzeliukns
Дата подписания: 17.02.2024

Н. С. Дзензелюк

Разработчик программы,
к.экон.н., доцент

Электронный документ, подписанный ПЭП, хранится в системе электронного документооборота Южно-Уральского государственного университета
ЮУрГУ
СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПЭП
Кому выдан: Зонов В. Л.
Пользователь: zonovvl
Дата подписания: 13.02.2024

В. Л. Зонов

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: 1) сформировать систему знаний о сущности и роли экономических рисков; 2) изучить методы выявления и оценки рисков; 3) изучить методы воздействия на риск; 4) познакомить с системой управления экономическими рисками; 5) 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
ПК-1 Способен проводить сбор и анализ информации о функциональных процессах и административных регламентах подразделений организации	Знает: - теоретические основы риск-менеджмента; - подходы к оценке и учету взаимодействия внешних и внутренних рисков и способы управления ими Умеет: - на основе анализа о деятельности и процессах подразделения разрабатывать карту рисков - разрабатывать предложения по обеспечению экономической безопасности для минимизации влияния рисков и снижения их последствий Имеет практический опыт: - организации мониторинга рисков, оценки их влияния и последствий, подготовки предложений по устранению условий их проявления
ПК-5 Способен выявлять и анализировать рыночные и специфические риски при решении задач управления бизнесом и проектами	Знает: - теорию рисков Умеет: - составлять реестр рисков проекта, разрабатывать мероприятия по работе с рисками Имеет практический опыт: - количественного и качественного анализа рисков

3. Место дисциплины в структуре ОП ВО

Перечень предшествующих дисциплин, видов работ учебного плана	Перечень последующих дисциплин, видов работ
1.Ф.01 Введение в профессиональную деятельность	1.Ф.06 Управление инновациями, 1.Ф.11 Бизнес-планирование

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

Дисциплина	Требования

1.Ф.01 Введение в профессиональную деятельность	Знает: - методики сбора и обработки бизнес-информации; - методы и инструменты обоснования и принятия решений Умеет: - собирать и обрабатывать информацию о деятельности отдельных подразделений и предприятия в целом; - принимать обоснованные экономические решения с учетом особенностей внешнего окружения Имеет практический опыт: - анализа информации о работе как отдельных подразделений так и предприятия в целом; - принятия экономических решений

4. Объём и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 2 з.е., 72 ч., 36,25 ч. контактной работы

Вид учебной работы	Всего часов	Распределение по семестрам в часах
		Номер семестра
		6
Общая трудоёмкость дисциплины	72	72
Аудиторные занятия:	32	32
Лекции (Л)	16	16
Практические занятия, семинары и (или) другие виды аудиторных занятий (ПЗ)	16	16
Лабораторные работы (ЛР)	0	0
Самостоятельная работа (СРС)	35,75	35,75
Подготовка к зачёту	27,75	27.75
Подготовка к практическим занятиям	8	8
Консультации и промежуточная аттестация	4,25	4,25
Вид контроля (зачет, диф.зачет, экзамен)	-	зачет

5. Содержание дисциплины

№ раздела	Наименование разделов дисциплины	Объем аудиторных занятий по видам в часах			
		Всего	Л	ПЗ	ЛР
1	Общие сведения об экономических рисках	2	2	0	0
2	Оценка и анализ экономических рисков	18	8	10	0
3	Методы управления экономическими рисками	12	6	6	0

5.1. Лекции

№ лекции	№ раздела	Наименование или краткое содержание лекционного занятия	Кол-во часов
1	1	Общие сведения об экономических рисках	2
2, 3	2	Оценка и анализ экономических рисков	4
4, 5	2	Оценка и анализ экономических рисков	4
6	3	Методы управления экономическими рисками	2
7	3	Управление рисками на производственном предприятии	2

8	3	Управление проектными рисками	2

5.2. Практические занятия, семинары

№ занятия	№ раздела	Наименование или краткое содержание практического занятия, семинара	Кол-во часов
1	2	Качественная оценка экономического риска	2
2	2	Количественная оценка экономического риска	2
3	2	Экспертный метод оценки риска	2
4	2	Метод Монте-Карло	2
5	2	Статистические методы оценки риска	2
6	3	Методы локализации и диссипации риска	2
7	3	Методы компенсации и распределения риска	2
8	3	Ограничение рисков	2

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
Подготовка к зачёту	1. Конспект лекций по дисциплине "Риск-менеджмент". 2. Риск-менеджмент, внутренний контроль и аудит. – http://svk4u.ru/. 3. Матвеев, Б.А. Управление рисками [Электронный ресурс]: курс лекций / Б.А. Матвеев. - Челябинск: ЮУрГУ, 2017. С. 4-72.	6	27,75
Подготовка к практическим занятиям	1. Матвеев, Б.А. Управление рисками [Электронный ресурс]: курс лекций / Б.А. Матвеев. - Челябинск: ЮУрГУ, 2017. - С. 9-13, 21-27, 30-70. 2. Маховикова, Г.А. Анализ и оценка рисков в бизнесе. - М.: Юрайт, 2014. - С. 254-275. 3. Риск-менеджмент инвестиционного проекта: учебник / Под ред. М.В. Грачёвой. - М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2009. - С. 7-173. 4. Фёдорова, Е.А. Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски. - М.: КНОРУС, 2010. - С. 107-125, 133-177. 5. Малашихина, Н.Н. Риск-менеджмент. – Ростов н/Д: Феникс, 2007. – С. 118-172. 6. Моделирование рисковых ситуаций в экономике и бизнесе / Под ред. Лагоши. - М.: Финансы и статистика, 2009. - С. 137-148.	6	8

6. Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации

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-мест	Вид контроля	Название контрольного мероприятия	Вес	Макс. балл	Порядок начисления баллов	Учи-тыва-ется в ПА
1	6	Текущий контроль	эссе	1	3	Задача изложить в краткой форме(в виде эссе) своё собственное мнение об определении рисков и о том, почему требуется управление рисками. Максимальный балл - 3 балла. Критерия оценивания: 1.Эссе соответствует заданию - 1 балл 2. Объем не менее 1 страницы А4 (но не более 2 страниц) , шрифт Times New Roman, размер шрифта-14 - 1 балл. 3. Сдача в установленный срок -1 балл.	зачет
2	6	Текущий контроль	Задача	0,5	5	Задание выдается в аудитории, на занятии. Преподаватель дает пояснения по решению задачи. Происходит решение подобной задачи. Задача состоит из 2х частей. Максимальный балл - 5 баллов. Критерии оценивания: 1. Решена одна часть верно - 2 балла (максимум 4 балла). 2. Решена одна часть с незначительными ошибками- 1 балл 3. Задание решена в срок - 1 балл	зачет
3	6	Текущий контроль	Задача	0,4	7	Задача –по приведенной ситуации корректно сформулировать любые пять рисков. Необходимую информацию разрешается додумывать. Максимальная оценка - 7 баллов. Критерии оценивания: 1. Сформулированы 1 риск - 1 балл (не более 5 рисков) . 2. Состоялась защита и обсуждение сформулированных рисков на паре - 1 балл. 3. Задача выполнена в строк - 1 балл.	зачет
4	6	Текущий	Тест	0,2	10	Тест состоит из 10 вопросов.	зачет

		контроль					
5	6	Проме-жуточная аттестация	Мероприятия промежуточной аттестации	-	10	Тест состоит из 10 вопросов.	зачет

6.2. Процедура проведения, критерии оценивания

Вид промежуточной аттестации	Процедура проведения	Критерии оценивания
зачет	На зачёте происходит оценивание учебной деятельности обучающихся по дисциплине на основе полученных баллов за контрольно-рейтинговые мероприятия текущего контроля и промежуточной аттестации. Студент может получить зачет на основе сформированного рейтинга или повысить свой результат.	В соответствии с пп. 2.5, 2.6 Положения

6.3. Паспорт фонда оценочных средств

Компетенции	Результаты обучения	№ КМ				
		1	2	3	4	5
ПК-1	Знает: - теоретические основы риск-менеджмента; - подходы к оценке и учету взаимодействия внешних и внутренних рисков и способы управления ими	+	+	+	+	+
ПК-1	Умеет: - на основе анализа о деятельности и процессах подразделения разрабатывать карту рисков - разрабатывать предложения по обеспечению экономической безопасности для минимизации влияния рисков и снижения их последствий				+	+
ПК-1	Имеет практический опыт: - организации мониторинга рисков, оценки их влияния и последствий, подготовки предложений по устранению условий их проявления				+	+
ПК-5	Знает: - теорию рисков	+	+	+	+	+
ПК-5	Умеет: - составлять реестр рисков проекта, разрабатывать мероприятия по работе с рисками			+	+	+
ПК-5	Имеет практический опыт: - количественного и качественного анализа рисков			+	+	+

Типовые контрольные задания по каждому мероприятию находятся в приложениях.

7. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

Печатная учебно-методическая документация

а) основная литература:

1. 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.
2. 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.

3. Шевелев, А. Е. Риски в бухгалтерском учете [Текст] учебное пособие для вузов по специальности "Бухгалт. учет, анализ и аудит" А. Е. Шевелев, Е. В. Шевелева. - 2-е изд., перераб. и доп. - М.: КноРус, 2008
4. Рогов, М. А. Риск-менеджмент [Текст] М. А. Рогов. - М.: Финансы и статистика, 2001. - 118,[1] с. ил.
5. Хохлов, Н. В. Управление риском [Текст] учеб. пособие для вузов Н. В. Хохлов. - М.: ЮНИТИ, 2001. - 238, [1] с.

б) дополнительная 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. Козлова, Е. А. Экономические и инвестиционные риски [Текст] учеб. пособие Е. А. Козлова, И. Г. Шепелев ; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Экономика, упр. и инвестиции ; ЮУрГУ. - Челябинск: Издательство ЮУрГУ, 2005. - 73, [1] с.
4. 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
5. 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.

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.

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.

Электронная учебно-методическая документация

№	Вид литературы	Наименование ресурса в электронной форме	Библиографическое описание
1	Основная литература	Электронный каталог	Матвеев Б.А. Управление рисками [Электронный ресурс]: курс лекций / Б.А. Матвеев. - Челябинск: ЮУрГУ, 2017. - 70 с.

		ЮУрГУ	http://www.lib.susu.ac.ru/ftd?base=SUSU_METHOD&key=000553255
2	Дополнительная литература	Электронно-библиотечная система издательства Лань	Шапкин, А.С. Экономические и финансовые риски: Оценка, управление, портфель инвестиций. / А.С. Шапкин, В.А. Шапкин. — М. : Дашков и К, 2016.— 544 с. https://e.lanbook.com/book/93337

Перечень используемого программного обеспечения:

1. Microsoft-Windows(бессрочно)
2. Microsoft-Office(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
Практические занятия и семинары	264 (2)	Проектор, ноутбук, интерактивная доска
Лекции	265 (3)	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)
Лекции	264 (2)	Проектор, ноутбук, интерактивная доска