

ЮЖНО-УРАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

УТВЕРЖДАЮ:
Руководитель направления



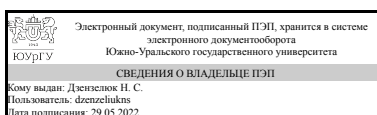
А. В. Карпушкина

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

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

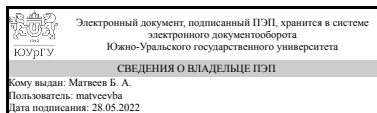
Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент, утверждённым приказом Минобрнауки от 12.08.2020 № 970

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



Н. С. Дзензелюк

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



Б. А. Матвеев

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.06 Управление инновациями, 1.Ф.01 Введение в профессиональную деятельность, 1.Ф.10 Практикум по виду профессиональной деятельности, 1.Ф.04 Теория организации и организационное поведение, 1.Ф.05 Операционный менеджмент, Производственная практика, технологическая	Не предусмотрены

(проектно-технологическая) практика (6 семестр)	
---	--

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

Дисциплина	Требования
1.Ф.05 Операционный менеджмент	Знает: - теорию операционного менеджмента, процессный подход Умеет: - моделировать управленческие решения по отдельным функциям Имеет практический опыт: анализа операционной (производственной) деятельности компании с использованием процессного и проектного подходов
1.Ф.01 Введение в профессиональную деятельность	Знает: - методы и инструменты обоснования и принятия решений, - методики сбора и обработки бизнес-информации Умеет: - принимать обоснованные экономические решения с учетом особенностей внешнего окружения, - собирать и обрабатывать информацию о деятельности отдельных подразделений и предприятия в целом Имеет практический опыт: - принятия экономических решений, - анализа информации о работе как отдельных подразделений так и предприятия в целом
1.Ф.04 Теория организации и организационное поведение	Знает: - сущность организации как системы и процесса, сущность законов организации, теоретические основы организационного поведения, - теорию межличностной и групповой коммуникации в деловом взаимодействии Умеет: - проводить качественную оценку влияния внешних факторов на проектирование организации, моделировать управленческие решения по построению базовой структуры организации и структуры отдельной функциональной службы, использовать типовые положения о подразделениях в целях организационного проектирования;- применять современные модели развития и управления компанией, - анализировать внутренние (внешние) факторы и условия, влияющие на деятельность организации- анализировать требования заинтересованных сторон с точки зрения критериев качества, определяемых выбранными подходами Имеет практический опыт: - проектирования организационной структуры функциональной службы в соответствии с поставленными целями, презентации предлагаемых организационных решений и участия в коллективной дискуссии по предлагаемым организационным решениям, инструментами распределения полномочий и ответственности по выполнению установленных

	функций , - принятия стратегических, тактических и оперативных решений в управлении компанией
1.Ф.06 Управление инновациями	Знает: - теорию управления инновациями, методы продвижения инновационного бизнеса, - методы и инструменты выявления и оценки рисков, связанных с инновационным продуктом Умеет: - разрабатывать бизнес-план инновационного проекта, формировать пакет управленческих решений для продвижения инновационного бизнеса, - выявлять и анализировать риски, связанные с разработкой и продвижением инновационного продукта Имеет практический опыт: - стратегического и инновационного мышления для принятия решений инновационного характера;- бизнес-планирования, в том числе для инновационного продукта, - оценки рисков, связанных с продвижением инновационного продукта, и разработки методов компенсации специфических рисков
1.Ф.10 Практикум по виду профессиональной деятельности	Знает: - принципы и подходы бизнес-планирования, в т.ч. разработку и реализацию корпоративной и конкурентной стратегии организации, функциональных стратегий, особенности формирования организационной и управленческой структуры организаций;- организацию сбора, обработки и анализа информации о факторах внешней и внутренней среды организации для оценки рисков и принятия управленческих решений; - принципы построения и поддержки функционирования внутренней информационной системы организации для сбора информации с целью принятия решений;- актуальные направления развития предпринимательской деятельности, этапы и особенности организации и ведения предпринимательской деятельности, - теорию процессного управления и особенности управления проектом Умеет: - координировать деятельность исполнителей с помощью методического инструментария реализации управленческих решений в области функционального менеджмента для достижения высокой согласованности при выполнении конкретных проектов и работ;- осуществлять планирование деятельности и контроля; создавать и вести базы данных по различным показателям функционирования организаций; разрабатывать и поддерживать функционирование системы внутреннего документооборота организации, ведение баз данных по различным показателям функционирования организаций;- разрабатывать и реализовывать бизнес-планы создания нового бизнеса, оценивать экономические и социальные

	условия осуществления предпринимательской деятельности, выявлять новые рыночные возможности и оценивать риски, - применять аналитические и расчетные методы в процедуре принятия управленческих решений по управлению проектами Имеет практический опыт: - поэтапного контроля реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений, договоров и контрактов;- оценки эффективности проектов; - подготовки отчетов по результатам информационно-аналитической деятельности;- формирования и оценки эффективности предпринимательской деятельности, - анализа операционной (производственной) деятельностью компании с использованием процессного и проектного подходов
Производственная практика, технологическая (проектно-технологическая) практика (6 семестр)	Знает: - основные методы оценки и прогнозирования рисков при решении задач управления бизнесом и проектами- методы и инструменты, применяемые для предупреждения рисков, - закономерности процесса планирования проектов и основные факторы и условия, определяющие их эффективность, - нормативно-правовые акты, методические материалы по вопросам организации управления предприятием, учета и анализа результатов производственно-хозяйственной деятельности;- методики анализа и оценки эффективности деятельности компании, - методы сбора и обработки экономической и бухгалтерской информации, а также осуществления технико-экономических расчетов и анализа хозяйственной деятельности организации, с использованием специализированных программных продуктов, - экономические критерии (показатели), используемые управленцами при принятии решений, - основные приемы эффективного управления собственным временем; - правила трудовой дисциплины и трудового распорядка места прохождения практики Умеет: - применять методы управления рисками при решении задач управления бизнесом и проектами, - моделировать бизнес-процессы и разрабатывать организационно-управленческие решения, связанные с развитием бизнеса;- использовать в практической деятельности организации информацию, полученную в результате маркетинговых исследований и сравнительного анализа лучших практик в менеджменте;- находить и оценивать новые рыночные возможности и разрабатывать организационно-управленческие решения по формированию бизнес-идей;- разрабатывать бизнес-планы создания и развития новых организаций (направлений деятельности, продуктов и т. п.), -

	разрабатывать организационно-техническую и организационно-экономическую документацию и составлять управленческую отчетность по утвержденным формам - рассчитывать показатели деятельности предприятия, определять пути повышения эффективности деятельности и разрабатывать рекомендации по ее повышению, - собирать и анализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических показателей, характеризующих деятельность организации; использовать специализированные программные продукты для обработки информации;- разрабатывать регламент процессов отдельных подразделений организации, - рассчитывать экономические показатели, которые учитываются при принятии управленческих решений в современных организациях;- принимать и обосновывать экономические решения касательно экономических проблем предприятия, - эффективно планировать и контролировать собственное время; - использовать методы саморегуляции, саморазвития и самообучения во время прохождения практики Имеет практический опыт: - оценки и прогнозирования рисков при решении задач управления бизнесом и проектами, - оценки экономических и социальных последствий организационно-управленческих решений, связанных с развитием бизнеса, - оценки показателей эффективности деятельности компании, разработки рекомендаций по ее повышению, - ввода исходных данных, их обработки в специализированных программных продуктах; мониторинга изменения данных для проведения расчетов экономических показателей организации и разработки регламентов процессов отдельных подразделений организации, - разработки управленческих рекомендаций для решения экономических проблем предприятия, - приобретения, использования и обновления социокультурных и профессиональных знаний, умений и навыков
--	--

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
		7
Общая трудоемкость 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 практическим занятиям	8	8
Подготовка к зачёту	27,75	27,75
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 риском 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 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 рискованных ситуаций в экономике и бизнесе / Под ред. Лагоши. - М.: Финансы и статистика, 2009. - С. 137-148.	7	8
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.	7	27,75

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-местр	Вид контроля	Название контрольного мероприятия	Вес	Макс. балл	Порядок начисления баллов	Учитывается в ПА
1	7	Текущий контроль	Реферат	0,2	5	Студент раскрывает тему реферата, анализирует материал, приводит источники информации, делает выводы. Показатели оценивания: Отлично (5 баллов) - реферат имеет логичное, последовательное изложение материала с соответствующими выводами и обоснованными положениями, есть ссылки на источники информации; Хорошо (4 балла) - реферат имеет не вполне обоснованные положения;	зачет

						Удовлетворительно (3 балла) - тема реферата раскрыта не полностью; Неудовлетворительно (0 баллов) - тема реферата не раскрыта, реферат не имеет анализа, в работе нет выводов	
2	7	Текущий контроль	Доклад	0,2	5	Тема доклада совпадает с темой реферата. Преподаватель и слушатели задают вопросы, обсуждаются выявленные проблемы. 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	зачет
3	7	Текущий контроль	Тест	0,2	10	Тест содержит 10 вопросов. На ответы отводится 20 мин. Показатели оценивания: правильный ответ на вопрос соответствует 1 баллу; неправильный - 0 баллов. Тест считается успешно пройденным, если дано не менее шести правильных ответов	зачет
4	7	Текущий контроль	Самостоятельная работа	0,4	5	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.	зачет
5	7	Промежуточная аттестация	Зачёт	-	5	Мероприятия промежуточной аттестации включают: доклад (презентацию) по теме самостоятельной работы и ответы на три	зачет

					вопроса. Критерии начисления баллов по докладу: 2 балла - есть своя презентация, доклад в полной мере раскрывает тему самостоятельной работы; 1 балл - есть своя презентация, которая не в полной мере раскрывает тему самостоятельной работы; 0 баллов - отсутствует своя презентация. Преподаватель предлагает прокомментировать чужую работу. Критерии начисления баллов за ответ на каждый вопрос: 1 балл - верный ответ на вопрос по теме доклада; 0 баллов - неверный ответ на вопрос по теме доклада.	
--	--	--	--	--	--	--

6.2. Процедура проведения, критерии оценивания

Вид промежуточной аттестации	Процедура проведения	Критерии оценивания
зачет	На зачёте студент может улучшить свой рейтинг, полученный по результатам текущего контроля.	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. Дубров, А. М. Моделирование рискованных ситуаций в экономике и бизнесе Учеб. пособие для вузов по специальности "Мат. методы и исслед. операций в экономике", "Информ. системы в экономике", "Статистика" А. М. Дубров, Б. А. Лагоша, Е. Ю. Хрусталева; Под ред. Б. А. Лагоши. - М.: Финансы и статистика, 2000. - 172,[1] с.

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. Човушян, Э. О. Управление риском и устойчивое развитие [Текст] Рос. экон. акад. им. Г. В. Плеханова. - М.: РЭА им. Г. В. Плеханова, 1999. - 526,[1] с. ил.

5. 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

6. 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.

7. 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.

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

1. Управление риском ежекв. журн. Фирма "Анkil" 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 ЮУрГУ	Матвеев Б.А. Управление рисками [Электронный ресурс]: курс лекций / Б.А. Матвеев. - Челябинск: ЮУрГУ, 2017. - 70 с. 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:

1. -База данных ВИНТИ РАН(бессрочно)

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
Лекции	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)