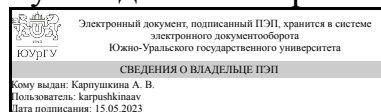


ЮЖНО-УРАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

УТВЕРЖДАЮ:
Руководитель направления



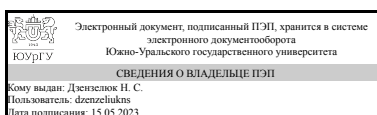
А. В. Карпушкина

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

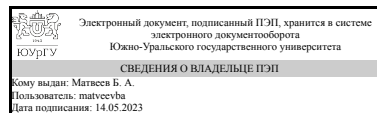
Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент, утверждённым приказом Минобрнауки от 12.08.2020 № 970

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

проектно-технологическая) (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.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: - теорию процессного управления и особенности управления проектом, - 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 Умеет: - применять аналитические и расчетные методы в процедуре принятия управленческих решений по управлению проектами, - 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 Имеет практический опыт: - анализа операционной (производственной) деятельностью компании с использованием процессного и проектного подходов, - 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
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: - 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
1.Ф.04 Теория организации и организационное поведение	Знает: - теорию межличностной и групповой коммуникации в деловом взаимодействии, - сущность организации как системы и процесса, сущность законов организации, теоретические основы организационного поведения Умеет: - анализировать внутренние (внешние) факторы и условия, влияющие на деятельность организации- анализировать требования заинтересованных сторон с точки зрения критериев качества, определяемых выбранными подходами, - 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 Имеет практический опыт: - принятия стратегических, тактических и оперативных решений в управлении компанией, - 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
Производственная практика (технологическая, проектно-технологическая) (6 семестр)	Знает: - нормативно-правовые акты, методические материалы по вопросам организации управления предприятием, учета и анализа результатов производственно-хозяйственной деятельности;- методики анализа и оценки эффективности деятельности компании, - основные методы оценки и прогнозирования рисков при решении задач управления бизнесом и проектами- методы и инструменты, применяемые для предупреждения рисков, - экономические критерии (показатели), используемые управленцами при принятии решений, - основные приемы эффективного управления собственным временем; - правила трудовой дисциплины и трудового распорядка места прохождения практики, - закономерности процесса планирования проектов и основные факторы и условия, определяющие их эффективность, - методы сбора и обработки экономической и бухгалтерской информации, а также осуществления технико-экономических расчетов и анализа хозяйственной деятельности организации, с использованием специализированных программных продуктов Умеет: - 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, - применять методы управления рисками при решении задач управления бизнесом и проектами, - 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, - 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.), - 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 Имеет практический опыт: - оценки показателей эффективности деятельности компании, разработки рекомендаций по ее повышению, - оценки и прогнозирования рисков при решении задач управления бизнесом и проектами, - разработки управленческих рекомендаций для решения экономических проблем предприятия, - приобретения, использования и обновления социокультурных и профессиональных знаний, умений и навыков, - оценки экономических и социальных последствий организационно-управленческих решений, связанных с развитием бизнеса, - 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
--	--

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)
3. ФГАОУ ВО "ЮУрГУ (НИУ)"-Портал "Электронный ЮУрГУ" (<https://edu.susu.ru>)(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
Контроль самостоятельной работы	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)
Практические занятия и семинары	264 (2)	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)
Зачет, диф.зачет	265 (3)	Проектор, ноутбук, интерактивная доска