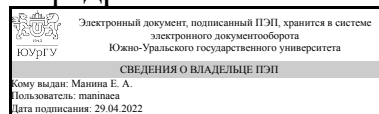


# ЮЖНО-УРАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

УТВЕРЖДАЮ:  
Заведующий выпускающей  
кафедрой



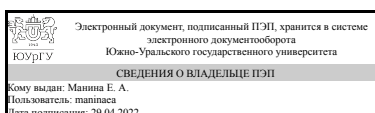
Е. А. Манина

## РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины 1.Ф.П1.02 Риск-менеджмент  
для направления 38.03.01 Экономика  
уровень Бакалавриат  
профиль подготовки Финансы и кредит  
форма обучения очная  
кафедра-разработчик Экономика, менеджмент и право

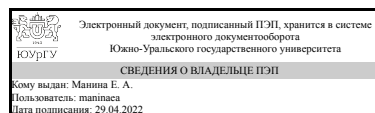
Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, утверждённым приказом Минобрнауки от 12.08.2020 № 954

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



Е. А. Манина

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



Е. А. Манина

## 1. Цели и задачи дисциплины

Целью дисциплины «Риск-менеджмент» является изучение способов и методов управления рисками, антикризисного регулирования и управления на макроуровне и микроуровне, а также изучение методов диагностики и процедур банкротства предприятия как крайнего проявления ситуации риска в организации. Задачи дисциплины: - описание видов чистых и спекулятивных рисков; - изучение методов трансформации рисков и финансирования рискового ущерба; - изучение методов количественной оценки рисков; - раскрытие сущности и форм проявления рисков и кризисов, как на макроуровне, так и на микроуровне; - знакомство с основами циклической теории развития организации; - изучение методов диагностики кризисного состояния организации; - подробное изучение процедур банкротства и методов его прогнозирования; - изучение методологии государственного антикризисного регулирования в ситуации риска; - овладение базовым методическим инструментарием риск-менеджмента; - изучение методологических вопросов реструктуризации бизнеса; - осознание роли профсоюзов в разрешении кризисных ситуаций; - рассмотрение вопросов стратегии и тактики антикризисного управления на микроуровне.

## Краткое содержание дисциплины

Основы теории рисков и кризисов Банкротство как крайняя форма рисковей ситуации в организации. Основы арбитражного процессуального законодательства Диагностика кризиса в организации Профсоюзы и их роль в риск-менеджменте Стратегия и тактика антикризисного управления в рисковей ситуации Реструктуризация предприятия в риск-менеджменте Методы управления обновлением основного капитала в условиях рисковей ситуации Методология риск-менеджмента в антикризисном управлении Оценка объектов в риск-менеджменте и антикризисном управлении

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

Планируемые результаты освоения ОП ВО (компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине
ПК-10 Способен определить события, которые могут влиять на деятельность организации, и управлять связанным с этими событиями риском, а также контроль отсутствия превышения предельно допустимого уровня риска организации и предоставление разумной гарантии достижения целей организации	Знает: возможности инструментов риск-менеджмента для анализа рисков организации; методы воздействия на риск; план мероприятий по управлению рисками; виды, методы, формы и инструменты внутреннего контроля; методы и инструменты, применяемые для предупреждения рисков несоответствия законодательству Российской Федерации и регуляторным требованиям; базовые положения международных стандартов по риск-менеджменту и смежным вопросам Умеет: определять эффективные методы воздействия на риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь

	ответственным за риск сотрудникам в правильной оценке риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики Имеет практический опыт: мониторинга рисков и мониторинга мероприятий по воздействию на риски
--	--

### 3. Место дисциплины в структуре ОП ВО

Перечень предшествующих дисциплин, видов работ учебного плана	Перечень последующих дисциплин, видов работ
Нет	Оценка активов и имущественное страхование, Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски, Предпринимательские риски малого бизнеса, Производственная практика, преддипломная практика (8 семестр)

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

Нет

### 4. Объём и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 2 з.е., 72 ч., 32,25 ч. контактной работы

Вид учебной работы	Всего часов	Распределение по семестрам в часах
		Номер семестра
		6
Общая трудоёмкость дисциплины	72	72
<i>Аудиторные занятия:</i>	32	32
Лекции (Л)	16	16
Практические занятия, семинары и (или) другие виды аудиторных занятий (ПЗ)	16	16
Лабораторные работы (ЛР)	0	0
<i>Самостоятельная работа (СРС)</i>	35,75	35,75
с применением дистанционных образовательных технологий	0	
Подготовка к практическим занятиям	10	10
Подготовка к экзамену	15,75	15.75
Изучение конспектов тем, не выносимых на лекции	10	10
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	Основы теории рисков и кризисов	8	4	4	0
2	Банкротство как крайняя форма рискованной ситуации в организации	8	4	4	0
3	Диагностика кризиса в организации	8	4	4	0
4	Методология риск-менеджмента в антикризисном управлении	8	4	4	0

### 5.1. Лекции

№ лекции	№ раздела	Наименование или краткое содержание лекционного занятия	Кол-во часов
1	1	Понятие и классификация кризисов. Понятие ситуации риска и неопределенности. Кризисы перепроизводства. Государственное антикризисное регулирование (проблемная лекция)	4
2	2	Понятие и признаки банкротства. Права кредиторов. Арбитражные управляющие. Наблюдение. Финансовое оздоровление. Внешнее управление. Конкурсное производство. Мировое соглашение	4
3	3	Методы диагностики кризисов. Модели Алтмана и Бивера. Отечественные методики диагностики кризиса в организации	4
4	4	Понятие и классификация экономических рисков. Методы трансформации рисков и финансирования рискованного ущерба	4

### 5.2. Практические занятия, семинары

№ занятия	№ раздела	Наименование или краткое содержание практического занятия, семинара	Кол-во часов
1	1	Письменное задание по основам теории рисков и кризисов	4
3	2	Тест по банкротству в рискованных ситуациях	4
2	3	Решение комплексной задачи по диагностике банкротства в условиях кризисных и рискованных ситуаций	4
4	4	Презентации по риск-менеджменту	2
5	4	Опрос студентов	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	Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент : учебник для бакалавров / А. Н. Фомичев. -	6	10

	7-е изд. - Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К <sup>о</sup> », 2020. - 372 с. - ISBN 978-5-394-03820-4. - URL: <a href="https://znanium.com/catalog/product/1091116">https://znanium.com/catalog/product/1091116</a> .		
Подготовка к экзамену	Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент : учебник для бакалавров / А. Н. Фомичев. - 7-е изд. - Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К <sup>о</sup> », 2020. - 372 с. - ISBN 978-5-394-03820-4. - URL: <a href="https://znanium.com/catalog/product/1091116">https://znanium.com/catalog/product/1091116</a> .	6	15,75
Изучение конспектов тем, не выносимых на лекции	Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 365 с. — ISBN 978-5-9916-3502-8. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/469020">https://urait.ru/bcode/469020</a> .	6	10

## 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-мestr	Вид контроля	Название контрольного мероприятия	Вес	Макс. балл	Порядок начисления баллов	Учитывается в ПА
1	6	Текущий контроль	Задание	0,3	2	При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179). Критерии начисления баллов: Соответствие терминов теме: Соответствует - 1 балл; Не соответствует – 0 балл; Многоаспектность интерпретации терминов и конкретизация их трактовки в соответствии со спецификой изучения дисциплины: Соответствует - 2 балл; Частично соответствует – 1 балл, Не соответствует – 0 балл Грамотность, отсутствие грамматических ошибок: Соответствует - 1 балл; Не соответствует – 0 балл; Соответствие оформления требованиям: Соответствует - 1 балл; Не соответствует – 0 балл.	зачет
2	6	Текущий контроль	Решение задачи	0,2	2	При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179). Критерии начисления баллов: Соответствие	зачет

						терминов теме: Соответствует - 1 балл; Не соответствует – 0 балл; Многоаспектность интерпретации терминов и конкретизация их трактовки в соответствии со спецификой изучения дисциплины: Соответствует - 2 балл; Частично соответствует – 1 балл, Не соответствует – 0 балл Грамотность, отсутствие грамматических ошибок: Соответствует - 1 балл; Не соответствует – 0 балл; Соответствие оформления требованиям: Соответствует - 1 балл; Не соответствует – 0 балл.	
3	6	Текущий контроль	Тест	0,3	2	При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179). Критерии начисления баллов: Соответствие терминов теме: Соответствует - 1 балл; Не соответствует – 0 балл; Многоаспектность интерпретации терминов и конкретизация их трактовки в соответствии со спецификой изучения дисциплины: Соответствует - 2 балл; Частично соответствует – 1 балл, Не соответствует – 0 балл Грамотность, отсутствие грамматических ошибок: Соответствует - 1 балл; Не соответствует – 0 балл; Соответствие оформления требованиям: Соответствует - 1 балл; Не соответствует – 0 балл.	зачет
4	6	Текущий контроль	презентация	0,2	2	При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179). Критерии начисления баллов: Соответствие терминов теме: Соответствует - 1 балл; Не соответствует – 0 балл; Многоаспектность интерпретации терминов и конкретизация их трактовки в соответствии со спецификой изучения дисциплины: Соответствует - 2 балл; Частично соответствует – 1 балл, Не соответствует – 0 балл Грамотность, отсутствие грамматических ошибок: Соответствует - 1 балл; Не соответствует – 0 балл; Соответствие оформления требованиям: Соответствует - 1 балл; Не соответствует – 0 балл.	зачет
5	6	Промежуточная аттестация	опрос	-	10	При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179). Критерии начисления баллов: Соответствие терминов теме: Соответствует - 1 балл; Не соответствует – 0 балл; Многоаспектность	зачет

					интерпретации терминов и конкретизация их трактовки в соответствии со спецификой изучения дисциплины: Соответствует - 2 балл; Частично соответствует – 1 балл, Не соответствует – 0 балл Грамотность, отсутствие грамматических ошибок: Соответствует - 1 балл; Не соответствует – 0 балл; Соответствие оформления требованиям: Соответствует - 1 балл; Не соответствует – 0 балл.	
--	--	--	--	--	--	--

## 6.2. Процедура проведения, критерии оценивания

Вид промежуточной аттестации	Процедура проведения	Критерии оценивания
зачет	Зачет проводится в устной форме. Обучающемуся выдается время на подготовку не менее 20 минут, и предлагается ответить на несколько основных вопросов, включенных в экзаменационный билет. Во время экзамена обучающиеся могут пользоваться учебной программой дисциплины, а также, с разрешения экзаменатора, справочной литературой, учебно-методическими пособиями и необходимыми техническими средствами. Экзаменатору предоставляется право задавать обучающимся дополнительные вопросы, не входящие в билет, а также помимо теоретических вопросов давать задачи и примеры по программе данной дисциплины. Итоговая отметка может выставляться также с учетом посещаемости студентом лекций и занятий, его текущей успеваемости и отметок по промежуточному контролю. При оценивании результатов учебной деятельности обучающегося по дисциплине используется балльно-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179) Итоговая оценка проставляется в ведомость, зачетную книжку и, в конечном итоге, в приложение к диплому.	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-10	Знает: возможности инструментов риск-менеджмента для анализа рисков организации; методы воздействия на риск; план мероприятий по управлению рисками; виды, методы, формы и инструменты внутреннего контроля; методы и инструменты, применяемые для предупреждения рисков несоответствия законодательству Российской Федерации и регуляторным требованиям; базовые положения международных стандартов по риск-менеджменту и смежным вопросам	+	+	+	+	+
ПК-10	Умеет: определять эффективные методы воздействия на риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственным за риск сотрудникам в правильной оценке риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики	+	+	+	+	+

ПК-10	Имеет практический опыт: мониторинга рисков и мониторинга мероприятий по воздействию на риски	+	+	+	+	+	+
-------	---	---	---	---	---	---	---

Типовые контрольные задания по каждому мероприятию находятся в приложениях.

## 7. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

### Печатная учебно-методическая документация

а) *основная литература:*

Не предусмотрена

б) *дополнительная литература:*

1. Финансовый менеджмент [Текст]: теория и практика: учебник / под ред. Е.С. Стояновой. - 6-е изд. – М.: Изд-во «Перспектива», 2010. – 656 с. - ISBN 978-5-88045-096-1..
2. Финансовый менеджмент [Текст]: учебник / под ред. Г.Б. Поляка. – 2-е изд., перераб. и доп. – М.:ЮНИТИ-ДАНА, 2009. – 527с. - ISBN 978-5-238-00645-1.

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

1. Проблемы теории и практики управления

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

1. Методические указания по изучению дисциплины "Риск-менеджмент"
2. Риск-менеджмент: методические указания по изучению дисциплины для обучающихся очной и заочной форм обучения для направлений подготовки бакалавров 38.03.01 Экономика и 38.03.02 Менеджмент / сост. А.В. Прокопьев. – Нижневартовск, 2018. - 14 с.

*из них: учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студента:*

### Электронная учебно-методическая документация

№	Вид литературы	Наименование ресурса в электронной форме	Библиографическое описание
1	Дополнительная литература	Электронно-библиотечная система издательства Лань	Фомичев, А.Н. Риск-менеджмент [Электронный ресурс] : учебник / А.Н. Фомичев. — Электрон. дан. — Москва : Дашков и К, 2016. — 372 с. — Режим доступа: <a href="https://e.lanbook.com/book/77294">https://e.lanbook.com/book/77294</a> . — Загл. с экрана.
2	Дополнительная литература	Электронно-библиотечная система издательства Лань	Кудрявцев, А.А. Введение в количественный риск-менеджмент [Электронный ресурс] : учебник / А.А. Кудрявцев, А.В. Радионов. — Электрон. дан. — Санкт-Петербург : СПбГУ, 2016. — 192 с. — Режим доступа: <a href="https://e.lanbook.com/book/78092">https://e.lanbook.com/book/78092</a> . — Загл. с экрана.
3	Основная 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, 2021. — 365 с. — ISBN 978-5-9916-3502-8. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/469020">https://urait.ru/bcode/469020</a> .
4	Основная	Электронно-	Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент : учебник для



литература	библиотечная система Znanium.com	бакалавров / А. Н. Фомичев. - 7-е изд. - Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2020. - 372 с. - ISBN 978-5-394-03820-4. - URL: <a href="https://znanium.com/catalog/product/1091116">https://znanium.com/catalog/product/1091116</a> .
------------	-------------------------------------	--

Перечень используемого программного обеспечения:

1. Microsoft-Office(бессрочно)

Перечень используемых профессиональных баз данных и информационных справочных систем:

1. -Консультант Плюс (Нижневартовск)(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		Учебная аудитория с мультимедийным оборудованием, 125 Для самостоятельной работы, проведения занятий лекционного и семинарского типа, текущего контроля и промежуточной аттестации Настенный экран для проектора, Проектор EPSONEB-W12 LCDprojector-1шт Монитор AcerAL 1717 FS-1шт, Рабочая станция IntelPentium4-1 шт Акустический комплект-1комп. Столы-парты-18 шт., Стулья – 36 шт., Стол преподавателя -1 шт., Стул мягкий-1шт. Radmin Server 3.4 - № 09/12 от 27.01.12 г - Бессрочно Windows 7 Prof - № 09/12 от 27.01.12 г - Бессрочно RollBack Rx Professional - № 09/12 от 27.01.12 г - Бессрочно Microsoft Office Prof 2013 - № 14/15 от 13.03.15 г. - Бессрочно Информационно-правовая база “КонсультантПлюс” - № 481180/19 от 28.12.18 - 1 год Kaspersky Endpoint Security для Windows - № 58370/ЕКТ2780 от 16.10.17 г. - 2 года Adobe Acrobat Reader - Бесплатное ПО (Proprietary) - Бессрочно Google Chrome - Бесплатное ПО (Proprietary) - Бессрочно Mozilla Firefox - Бесплатное ПО (Proprietary) - Бессрочно Far Manager 2 - Свободное ПО (BSDL) - Бессрочно 7-Zip - Свободное ПО (GNU LGPL) - Бессрочно Учебная аудитория,119 Для самостоятельной работы, проведения занятий лекционного и семинарского типа, текущего контроля и промежуточной аттестации Столы-парты-21 шт., Стулья деревянные – 42 шт., Стол преподавателя -1 шт., Стул мягкий-1шт. Шкаф для документов-1шт
Лекции		Учебная аудитория с мультимедийным оборудованием, 125 Для самостоятельной работы, проведения занятий лекционного и семинарского типа, текущего контроля и промежуточной аттестации Настенный экран для проектора, Проектор EPSONEB-W12 LCDprojector-1шт Монитор AcerAL 1717 FS-1шт, Рабочая станция IntelPentium4-1 шт Акустический комплект-1комп. Столы-парты-18 шт., Стулья – 36 шт., Стол преподавателя -1 шт., Стул мягкий-1шт. Radmin Server 3.4 - № 09/12 от 27.01.12 г - Бессрочно Windows 7 Prof - № 09/12 от 27.01.12 г - Бессрочно RollBack Rx Professional - № 09/12 от 27.01.12 г - Бессрочно Microsoft Office Prof 2013 - № 14/15 от 13.03.15 г. - Бессрочно Информационно-правовая база “КонсультантПлюс” - № 481180/19 от 28.12.18 - 1 год Kaspersky Endpoint Security для Windows - № 58370/ЕКТ2780 от 16.10.17 г. - 2 года Adobe Acrobat Reader - Бесплатное ПО (Proprietary) - Бессрочно Google Chrome - Бесплатное ПО (Proprietary) - Бессрочно Mozilla Firefox - Бесплатное ПО (Proprietary) - Бессрочно Far Manager 2 - Свободное ПО (BSDL) - Бессрочно 7-Zip - Свободное ПО (GNU LGPL) - Бессрочно Учебная аудитория,119 Для самостоятельной работы,

		проведения занятий лекционного и семинарского типа, текущего контроля и промежуточной аттестации Столы-парты-21 шт., Стулья деревянные – 42 шт., Стол преподавателя -1 шт., Стул мягкий-1шт. Шкаф для документов-1шт
--	--	--