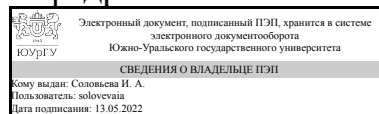


ЮЖНО-УРАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

УТВЕРЖДАЮ:
Заведующий выпускающей
кафедрой



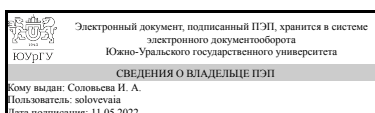
И. А. Соловьева

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины 1.Ф.М1.15 Риск-менеджмент и антикризисное управление
для направления 38.04.08 Финансы и кредит
уровень Магистратура
магистерская программа Финансовые механизмы бизнес-процессов
форма обучения заочная
кафедра-разработчик Экономика и финансы

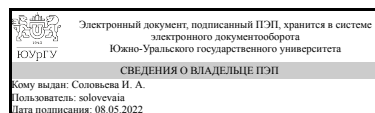
Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит, утверждённым приказом Минобрнауки от 12.08.2020 № 991

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



И. А. Соловьева

Разработчик программы,
д.экон.н., доц., профессор



И. А. Соловьева

1. Цели и задачи дисциплины

Целью данного курса является формирование у слушателей комплексного подхода к проблеме управления рисками, с целью многостороннего анализа и своевременного принятия эффективных решений в рамках минимизации рисков осуществления хозяйственной деятельности. Задачами курса являются: - изучение основных понятий теории риск-менеджмента - рассмотрение классификации рисков факторов - апробация на практике методов и способов оценки риска - приобретение практических навыков построения системы управления рисками - анализ мирового и отечественного опыта внедрения риск-менеджмента - познание способов повышения эффективности применения корпоративного риск-менеджмента

Краткое содержание дисциплины

Необходимыми для изучения данной дисциплины являются: знания по финансовой деятельности предприятия, навыки анализа экономической ситуации, умение составления расчетов по оценке экономических показателей, способности к обобщению и моделированию

2. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины

Планируемые результаты освоения ОП ВО (компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине
УК-6 Способен определять и реализовывать приоритеты собственной деятельности и способы ее совершенствования на основе самооценки	Знает: приоритеты антикризисного управления и методы риск-менеджмента Умеет: определять и реализовывать приоритеты риск-менеджмента и антикризисного управления Имеет практический опыт: самооценки при риск-менеджменте
ПК-4 Способен идентифицировать и минимизировать риски при принятии финансовых решений, разрабатывать методологию процесса финансового планирования, стандартизировать процессы финансового консультирования в организации, в том числе финансово-кредитной	Знает: основные подходы к оценке рисков и антикризисному управлению; основы бизнес-планирования и прогнозирования кризисных состояний Умеет: выделять ключевые и обеспечивающие бизнес-процессы организации; идентифицировать различные виды рисков, анализировать их путем интерпретирования финансово-экономической информации различных источников, в том числе в финансовой отчетности Имеет практический опыт: проведения расчетов по оценке финансовых рисков; практический опыт управления проектами, направленными на минимизацию финансовых рисков

3. Место дисциплины в структуре ОП ВО

Перечень предшествующих дисциплин, видов работ учебного плана	Перечень последующих дисциплин, видов работ
Лидерство и командный менеджмент, Кредитные рейтинги и кредитоспособность,	Производственная практика, преддипломная практика (5 семестр),

Управление кредитной организацией, Учебная практика, ознакомительная практика (2 семестр), Производственная практика, научно-исследовательская работа (3 семестр)	Производственная практика, научно-исследовательская работа (5 семестр)
---	--

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

Дисциплина	Требования
Кредитные рейтинги и кредитоспособность	<p>Знает: основные рейтинги и индексы, используемые для оценки кредитоспособности организаций и ценных бумаг, методики оценки кредитных рейтингов и кредитоспособности</p> <p>Умеет: анализировать данные финансового рынка, вести сбор достоверной и своевременной информации обо всех операциях организации и на этой основе оценивать ее развитие, осуществлять критический анализ кредитных рейтингов и кредитоспособности участников рынка</p> <p>Имеет практический опыт: финансового консультирования в организации, в том числе финансово-кредитной; практический опыт понимания особенностей различных видов бизнеса организации и его функционирования, к подходу по выработке стратегий обеспечения кредитоспособности</p>
Лидерство и командный менеджмент	<p>Знает: - технологии лидерства и командообразования; - особенности и проблемы подбора эффективной команды; - условия эффективной командной работы; - теории и стили лидерства, стили руководства в зависимости от деловых ситуаций; - основы стратегического управления человеческими ресурсами, нормативные правовые акты, касающиеся организации и осуществления профессиональной деятельности; - стратегии и принципы командной работы, основные характеристики организационного климата и взаимодействия людей в организации для достижения поставленной цели. , - понятие персонального менеджмента, его составные части, содержание основных функций, принципы организации собственной эффективности; - современные тенденции развития личности, технологию поиска и формулирования жизненных целей; - технику планирования своего времени для реализации приоритетов собственной деятельности; - критерии оценки уровня организации труда и пути его рационализации; - способы совершенствования деятельности на основе самооценки; - методы диагностики и прогнозирования собственного карьерного роста в сфере профессиональной</p>

	<p>деятельности; - принципы самоорганизации личного здоровья и правила гигиены умственного труда. Умеет: - определять стиль управления и оценивать эффективность руководства командой; - выработать командную стратегию и на ее основе организовать отбор членов команды для достижения поставленных целей;- владеть технологией реализации основных функций управления; - применять принципы и методы организации командной деятельности;- планировать и корректировать работу команды с учетом интересов, особенностей и поведения ее членов;- разрешать конфликты и противоречия при деловом общении на основе учета интересов всех сторон., - структурировать и организовывать рабочее и личное время, формулировать жизненные цели и принимать решения, оценивать эффективность организации управленческого труда; - реализовывать приоритеты собственной деятельности и способы ее совершенствования на основе самооценки;- конструировать собственный имидж и позиционировать собственную успешность в профессиональной среде. Имеет практический опыт: - планирования и организации работы в команде, распределения поручений и делегирования полномочий членам команды;- организации и управления командным взаимодействием в решении поставленных целей; - создания команды для выполнения практических задач разного уровня сложности; - участия в разработке стратегии командной работы; - организации коммуникаций и взаимодействия членов команды;- выявления и разрешения конфликтов и противоречий при деловом общении на основе учета интересов всех сторон., - планирования и эффективного использования рабочего времени; - анализа эффективности использования своего времени и определения резервов его оптимизации;- самоорганизации и саморазвития.</p>
<p>Управление кредитной организацией</p>	<p>Знает: основные нормативно-правовые документы в области регулирования банковской деятельности ;риски, связанные с основными видами деятельности кредитных организаций, проблемы деятельности и управления кредитной организацией Умеет: оценивать ресурсные затраты, необходимые для обеспечения эффективного внедрения и функционирования процесса финансового консультирования и финансового планирования в кредитной организации, вести критический анализ проблемных ситуаций кредитного процесса Имеет практический опыт: периодической актуализации основных положений и принципов</p>

	<p>методологии финансового планирования в кредитной организации; идентификации и минимизации рисков кредитной организации, к подходу выработки стратегий по разрешению проблем кредитной деятельности</p>
<p>Производственная практика, научно-исследовательская работа (3 семестр)</p>	<p>Знает: основные методы комплексного экономического и финансового анализа организации и бизнес-процессов в организации-объекте исследования (3 семестр), методы составления бюджетов и финансовых планов объекта исследования на стратегическом уровне в хронологии последних трех лет, состояние управления финансовой деятельности организации, приоритеты сбора и оценки материалов для подготовки отчета по научно-исследовательской работе (3 семестр) Умеет: проводить первичный комплексный экономический и финансовый анализ организации и бизнес-процессов, обосновывать подходы, используемые в бизнес-анализе, вести анализ всего спектра финансовых инструментов, используемых на объекте исследования, вести критический анализ доступных материалов по организации финансовой деятельности организации, совершенствовать способы самооценки в ходе выполнения научно-исследовательской работы (3 семестр) Имеет практический опыт: первичного комплексного экономического и финансового анализа бизнес-процессов организации-объекта исследования, оценки результатов формирования целевого инвестиционного портфеля на объекте исследования, выявления проблем в организации финансовой деятельности предприятия и разрабатывать проекты стратегий ее улучшения, определения приоритетов сбора и оценки материалов для подготовки отчета по научно-исследовательской работе (3 семестр)</p>
<p>Учебная практика, ознакомительная практика (2 семестр)</p>	<p>Знает: основные методы, формы и приемы учебного процесса в высшей школе, включая методы активного обучения; методы проведения самооценки; критерии приоритезации видов собственной деятельности на основе результатов самооценки, способы самосовершенствования за счет участия в учебной деятельности, источники учебных материалов для выявления и исследования актуальных проблем в финансовых отраслях экономики, основы командной работы в системе образования, формы командной работы над совместным исследованием Умеет: проводить самооценку, использовать выбранные критерии для установления приоритетов собственной деятельности и ее совершенствования за счет участия в учебном процессе, формировать учебные материалы для мониторинга информации необходимой для</p>

	проведения бизнес- анализа, составления на ее основе финансовых обзоров и отчетов, формировать команду, ставить цель и задачи перед ней, способы вовлечения членов команды в работу, распределения ролей Имеет практический опыт: реализации различных методов, форм и приемов учебного процесса в высшей школе, мониторинга информации необходимой для проведения бизнес- анализа и составления на ее основе финансовых обзоров и отчетов, работы в команде и руководства командой при решении задач в процессе обучения
--	---

4. Объём и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 з.е., 108 ч., 12,5 ч. контактной работы

Вид учебной работы	Всего часов	Распределение по семестрам в часах	
		Номер семестра	
		4	
Общая трудоёмкость дисциплины	108	108	
<i>Аудиторные занятия:</i>	12	12	
Лекции (Л)	4	4	
Практические занятия, семинары и (или) другие виды аудиторных занятий (ПЗ)	8	8	
Лабораторные работы (ЛР)	0	0	
<i>Самостоятельная работа (СРС)</i>	87,5	87,5	
с применением дистанционных образовательных технологий	0		
Подготовка к тестированию в рамках текущего контроля знаний	60	60	
Подготовка к экзамену	27,5	27,5	
Консультации и промежуточная аттестация	8,5	8,5	
Вид 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	Теории риск-менеджмента. Методы оценки рисков хозяйственной деятельности	6	2	4	0
2	Управление рисками. Антикризисное управление	6	2	4	0

5.1. Лекции

№ лекции	№ раздела	Наименование или краткое содержание лекционного занятия	Кол-во
----------	-----------	---	--------

			часов
1	1	Идентификация корпоративных рисков: понятие, факторы. оценка рисков	2
2	2	Методы нейтрализации рисков хозяйственной деятельности, антикризисное управление	2

5.2. Практические занятия, семинары

№ занятия	№ раздела	Наименование или краткое содержание практического занятия, семинара	Кол-во часов
1	1	Основы теории рисков	2
2	1	Методики проведения расчетов по оценке рисков	2
3,4	2	Методы анализа и управления рисками	4

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 тестированию в рамках текущего контроля знаний	Дамодаран, А. Инвестиционная оценка: Инструменты и методы оценки любых активов А. Дамодаран; Пер. с англ. Д. Липинского и др. - 2-е изд., испр. - М.: Альпина Бизнес Букс, 2005. - XVI,1323 с.	4	60
Подготовка к экзамену	Дамодаран, А. Инвестиционная оценка: Инструменты и методы оценки любых активов А. Дамодаран; Пер. с англ. Д. Липинского и др. - 2-е изд., испр. - М.: Альпина Бизнес Букс, 2005. - XVI,1323 с.	4	27,5

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	Учи-тыва-ется в ПА
1	4	Текущий контроль	тестирование	1	20	Количество вопросов, формируемых компьютером самостоятельно - 20 Время, отводимое на тестирование 40 минут. При оценивании результатов мероприятия используется балльно-рейтинговая система	экзамен

						оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179) Правильный ответ на вопрос соответствует 1 баллу. Неправильный ответ на вопрос соответствует 0 баллов. Максимальное количество баллов - 20	
2	4	Текущий контроль	Решение кейса	5	3	В рамках решения кейса необходимо оценить риски методами анализа чувствительности и методом операционного анализа 0 баллов - решение кейса отсутствует 1 балл - выполнены необходимые расчеты, выводы по кейсу или не сформулированы вообще или не по всем вопросам кейса 2 балла - выполнены необходимые расчеты, сформулированы выводы. не все расчеты и выводы полностью корректны 3 балла - выполнены все необходимые расчеты, сформулированы полностью корректные выводы по всем поставленным в кейсе вопросам	экзамен
3	4	Текущий контроль	Решение кейса	5	3	В рамках решения кейса необходимо оценить риски методами сценарного анализа 0 баллов - решение кейса отсутствует 1 балл - выполнены необходимые расчеты, выводы по кейсу или не сформулированы вообще или не по всем вопросам кейса 2 балла - выполнены необходимые расчеты, сформулированы выводы. не все расчеты и выводы полностью корректны 3 балла - выполнены все необходимые расчеты, сформулированы полностью корректные выводы по всем поставленным в кейсе вопросам	экзамен
4	4	Текущий контроль	Решение кейса	5	3	В рамках решения кейса необходимо охарактеризовать систему риск-менеджмента предприятия и предложить свои рекомендации 0 баллов - решение кейса отсутствует 1 балл - выполнен необходимый анализ, выводы по кейсу или не сформулированы вообще или не по всем вопросам кейса 2 балла - выполнен необходимый анализ, сформулированы выводы. не все выводы полностью корректны 3 балла - выполнен необходимый анализ, сформулированы полностью корректные выводы по всем поставленным в кейсе вопросам	экзамен
5	4	Промежуточная аттестация	тестирование	-	30	В тесте 30 вопросов Правильный ответ на вопрос соответствует 1 баллу. Неправильный ответ на вопрос - 0 баллов	экзамен

6.2. Процедура проведения, критерии оценивания

Вид промежуточной аттестации	Процедура проведения	Критерии оценивания
экзамен	<p>На экзамене происходит оценивание знаний, умений и приобретенного опыта обучающихся по дисциплине на основе полученных оценок за контрольно-рейтинговые мероприятия текущего контроля. Прохождение контрольного мероприятия промежуточной аттестации не является обязательным для студента. При недостаточной и/или не устраивающей студента величине рейтинга ему может быть предложено пройти контрольно-рейтинговое мероприятие промежуточной аттестации. Промежуточная аттестация проходит в форме тестирования. в тесте 30 вопросов теоретического и расчетного характера. На тест отводится 1,5 часа. правильный ответ на тестовый вопрос - 1 балл. неправильный - 0 баллов. В результате складывается совокупный рейтинг студента, который дифференцируется в оценку и проставляется в ведомость, зачетную книжку студента. Оценка "Отлично" выставляется если рейтинг студента выше 85%, оценка "Хорошо" - если рейтинг студента от 75 до 84%, оценка "удовлетворительно" - если рейтинг студента от 60 до 74%, оценка "неудовлетворительно", если рейтинг студента ниже 60%.</p>	В соответствии с пп. 2.5, 2.6 Положения

6.3. Паспорт фонда оценочных средств

Компетенции	Результаты обучения	№ КМ				
		1	2	3	4	5
УК-6	Знает: приоритеты антикризисного управления и методы риск-менеджмента	+				+
УК-6	Умеет: определять и реализовывать приоритеты риск-менеджмента и антикризисного управления					++
УК-6	Имеет практический опыт: самооценки при риск-менеджменте					++
ПК-4	Знает: основные подходы к оценке рисков и антикризисному управлению; основы бизнес-планирования и прогнозирования кризисных состояний	+				+
ПК-4	Умеет: выделять ключевые и обеспечивающие бизнес-процессы организации; идентифицировать различные виды рисков, анализировать их путем интерпретирования финансово-экономической информации различных источников, в том числе в финансовой отчетности	+	+	+		+
ПК-4	Имеет практический опыт: проведения расчётов по оценке финансовых рисков; практический опыт управления проектами, направленными на минимизацию финансовых рисков	+	+	+		+

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:

Не предусмотрена

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

1. Проблемы анализа Риска;
2. Управление риском;

г) методические указания для студентов по освоению дисциплины:

1. Риск-менеджмент и антикризисное управление

из них: учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студента:

1. Риск-менеджмент и антикризисное управление

Электронная учебно-методическая документация

№	Вид литературы	Наименование ресурса в электронной форме	Библиографическое описание
1	Основная литература	Электронно-библиотечная система издательства Лань	Тактаров, Г.А. Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски. [Электронный ресурс] / Г.А. Тактаров, Е.М. Григорьева. — Электрон. дан. — М. : Финансы и статистика, 2014. — 257 с. — Режим доступа: http://e.lanbook.com/book/69226
2	Дополнительная литература	Электронно-библиотечная система издательства Лань	Кожухина, К.А. Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски: Электронный учебный курс. [Электронный ресурс] : учеб. пособие — Электрон. дан. — СПб. : ИЭО СПбУТУиЭ, 2011. — 99 с. — Режим доступа: http://e.lanbook.com/book/64089
3	Методические пособия для самостоятельной работы студента	Электронно-библиотечная система издательства Лань	Родионова, Е.В. Финансовая среда и управление рисками организации: конспект лекций [Электронный ресурс] : учебное пособие / Е.В. Родионова. — Электрон. дан. — Йошкар-Ола : ПГТУ, 2017. — 56 с. — Режим доступа: https://e.lanbook.com/book/98182 . — Загл. с экрана.
4	Основная литература	Электронно-библиотечная система издательства Лань	Дамодаран, А. Инвестиционная оценка: Инструменты и методы оценки любых активов / А. Дамодаран ; перевод Д. Липинского [и др.]. — 5-е изд. . — Москва : Альпина Паблишер, 2016. — 1340 с. — ISBN 978-5-9614-0802-7. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: https://e.lanbook.com/book/95541 (дата обращения: 20.02.2022). — Режим доступа: для авториз. пользователей.

Перечень используемого программного обеспечения:

1. -Project Expert(бессрочно)
2. -1С:Предприятие 8. Комплект для обучения в высших и средних уч.заведениях(бессрочно)

Перечень используемых профессиональных баз данных и информационных справочных систем:

1. ООО "Акцион-пресс"-База данных "Финансовый директор"(28.02.2023)

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Вид занятий	№ ауд.	Основное оборудование, стенды, макеты, компьютерная техника, предустановленное программное обеспечение, используемое для различных видов занятий
Лекции	402 (1)	мультимедиа
Экзамен	410 (1)	проектор, 13 компьютеров
Практические занятия и семинары	410 (1)	проектор, 13 компьютеров
Самостоятельная работа студента	410 (1)	проектор, 13 компьютеров