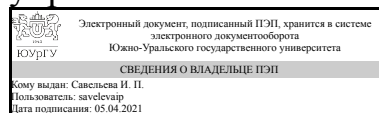


ЮЖНО-УРАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

УТВЕРЖДАЮ:
Директор института
Высшая школа экономики и
управления



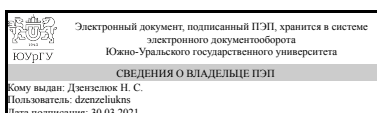
И. П. Савельева

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины В.1.09 Риск-менеджмент
для направления 38.03.01 Экономика
уровень бакалавр тип программы Академический бакалавриат
профиль подготовки Международная экономика и торговля
форма обучения очная
кафедра-разработчик Экономика промышленности и управление проектами

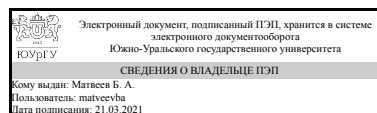
Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, утверждённым приказом Минобрнауки от 12.11.2015 № 1327

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



Н. С. Дзензелук

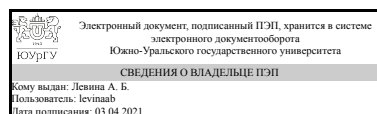
Разработчик программы,
к.техн.н., доц., доцент



Б. А. Матвеев

СОГЛАСОВАНО

Зав.выпускающей кафедрой
Менеджмент
к.экон.н., доц.



А. Б. Левина

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 (ЗУНы)
ПК-5 способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений	Знать: методы анализа экономического риска.
	Уметь: оценивать экономические риски.
	Владеть: навыками принятия организационно-управленческих решений.
ОПК-2 способностью осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач	Знать: методы сбора, анализа и обработки данных, необходимых для решения профессиональных задач.
	Уметь: выявлять и оценивать экономические риски.
	Владеть: методами оценки экономического риска.
ОПК-4 способностью находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовность нести за них ответственность	Знать: последствия воздействия риск-факторов на результаты деятельности хозяйствующего субъекта.
	Уметь: выбрать организационно-управленческое решение, оптимизирующее риски.
	Владеть: навыками принятия управленческих решений в рискованных ситуациях.

3. Место дисциплины в структуре ОП ВО

Перечень предшествующих дисциплин, видов работ учебного плана	Перечень последующих дисциплин, видов работ
Б.1.07 Микроэкономика, В.1.07 Экономическая статистика	Не предусмотрены

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

Дисциплина	Требования
В.1.07 Экономическая статистика	Знать: основы построения статистических показателей. Уметь: собирать, обрабатывать и анализировать статистические данные. Владеть: методиками расчёта экономических показателей.
Б.1.07 Микроэкономика	Знать: закономерности функционирования организации. Уметь: анализировать внешнюю и внутреннюю среду организации, оценивать влияние внутренних и внешних факторов на результаты хозяйственной деятельности организации. Владеть: методами оценки воздействия внутренних и внешних факторов на функционирование организации.

4. Объём и виды учебной работы

Общая трудоёмкость дисциплины составляет 3 з.е., 108 ч.

Вид учебной работы	Всего часов	Распределение по семестрам в часах	
		Номер семестра	
		7	
Общая трудоёмкость дисциплины	108	108	
<i>Аудиторные занятия:</i>	48	48	
Лекции (Л)	32	32	
Практические занятия, семинары и (или) другие виды аудиторных занятий (ПЗ)	16	16	
Лабораторные работы (ЛР)	0	0	
<i>Самостоятельная работа (СРС)</i>	60	60	
Подготовка к практическим занятиям	33	33	
Подготовка к экзамену	27	27	
Вид итогового 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	Общие сведения об экономических рисках	2	2	0	0
2	Управление экономическими рисками	6	6	0	0
3	Анализ и оценка экономических рисков	18	8	10	0
4	Методы управления экономическими рисками	12	6	6	0
5	Риск-менеджмент в различных отраслях экономической деятельности	10	10	0	0

5.1. Лекции

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

1	1	Общие сведения об экономических рисках	2
2-4	2	Управление экономическими рисками	6
5, 6	3	Анализ экономических рисков	4
7, 8	3	Оценка экономических рисков	4
9-11	4	Методы управления экономическими рисками	6
12	5	Управление риском на производственном предприятии	2
13, 14	5	Управление проектными рисками	4
15, 16	5	Управление рисками в банковской системе и страховом бизнесе	4

5.2. Практические занятия, семинары

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

5.3. Лабораторные работы

Не предусмотрены

5.4. Самостоятельная работа студента

Выполнение СРС		
Вид работы и содержание задания	Список литературы (с указанием разделов, глав, страниц)	Кол-во часов
Подготовка к экзамену	Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины	27
Подготовка к практическим занятиям	1. Матвеев, Б.А. Управление рисками [Электронный ресурс]: курс лекций / Б.А. Матвеев. - Челябинск: ЮУрГУ, 2017. - С. 3-70. 2. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент [Текст] учебник для вузов по экон. направлениям В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский; Финанс. ун-т при Правительстве Рос. Федерации. - 2-е изд., перераб. и доп. - М.: Юрайт, 2017. - С. 5-365. 3. Маховикова, Г.А. Анализ и оценка рисков в бизнесе. - М.: Юрайт, 2014. - С. 6-464. 4. Риск-менеджмент инвестиционного проекта: учебник / Под ред. М.В. Грачёвой. - М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2009. - С. 3-544. 5. Фёдорова, Е.А. Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски. - М.: КНОРУС, 2010. - С. 90-176. 6. Малашихина, Н.Н. Риск-менеджмент. –	33

	Ростов н/Д: Феникс, 2007. – С. 118-317. 7. Банковские риски: учебник / Под ред. О. И. Лаврушина. - М.: КНОРУС, 2016. - С. 5-289. 8. Моделирование рискованных ситуаций в экономике и бизнесе / Под ред. Лагоши. - М.: Финансы и статистика, 2009. - С. 11-207.	
--	--	--

6. Инновационные образовательные технологии, используемые в учебном процессе

Инновационные формы учебных занятий	Вид работы (Л, ПЗ, ЛР)	Краткое описание	Кол-во ауд. часов
Групповая дискуссия	Практические занятия и семинары	1. Задаётся тема с обозначением существующих проблем 2. Коллективно обсуждается конкретная проблема (анализируется конкретная ситуация) 3. Сопоставляются разные позиции, мнения, предложения, генерируются идеи 4. Вырабатывается единое или компромиссное решение	8

Собственные инновационные способы и методы, используемые в образовательном процессе

Не предусмотрены

Использование результатов научных исследований, проводимых университетом, в рамках данной дисциплины: Разработан спектральный метод оценки экономических рисков.

7. Фонд оценочных средств (ФОС) для проведения текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины

7.1. Паспорт фонда оценочных средств

Наименование разделов дисциплины	Контролируемая компетенция ЗУНы	Вид контроля (включая текущий)	№№ заданий
Общие сведения об экономических рисках	ОПК-4 способностью находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовность нести за них ответственность	Экзамен	Вопросы: 2
Все разделы	ОПК-4 способностью находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовность нести за них ответственность	Экзамен	Вопросы: 1, 2, 4-6, 27
Общие сведения об экономических рисках	ОПК-2 способностью осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач	Экзамен	Вопросы: 3
Анализ и оценка экономических рисков	ОПК-2 способностью осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач	Экзамен	Вопросы: 7-15

Все разделы	ОПК-2 способностью осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач	Экзамен	Вопросы: 7-15
Методы управления экономическими рисками	ПК-5 способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений	Экзамен	Вопросы: 16-23
Риск-менеджмент в различных отраслях экономической деятельности	ПК-5 способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений	Экзамен	Вопросы: 24-26
Все разделы	ПК-5 способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений	Экзамен	Вопросы: 16-26
Управление экономическими рисками	ОПК-4 способностью находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовность нести за них ответственность	Реферат	Темы: 2, 4, 6, 8
Анализ и оценка экономических рисков	ОПК-2 способностью осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач	Реферат	Темы: 4, 5, 15-21
Методы управления экономическими рисками	ПК-5 способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений	Реферат	Темы: 8, 10, 11, 21
Общие сведения об экономических рисках	ОПК-4 способностью находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовность нести за них ответственность	Тест	Вопросы: 1-25
Управление экономическими рисками	ОПК-4 способностью находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовность нести за них ответственность	Тест	Вопросы: 1-25
Анализ и оценка экономических рисков	ОПК-2 способностью осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач	Тест	Вопросы: 26-85
Методы управления экономическими	ПК-5 способностью анализировать и интерпретировать финансовую,	Тест	Вопросы: 26-85

рисками	бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений		
Риск-менеджмент в различных отраслях экономической деятельности	ПК-5 способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений	Тест	Вопросы: 26-85
Управление экономическими рисками	ОПК-4 способностью находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовность нести за них ответственность	Доклад	Темы: 2, 4, 6, 8
Анализ и оценка экономических рисков	ОПК-2 способностью осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач	Доклад	Темы: 4, 5, 15-21
Методы управления экономическими рисками	ПК-5 способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений	Доклад	Темы: 8, 10, 11, 21
Все разделы	ПК-5 способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений	Бонусное задание	Утвержденный перечень мероприятий

7.2. Виды контроля, процедуры проведения, критерии оценивания

Вид контроля	Процедуры проведения и оценивания	Критерии оценивания
Экзамен	На экзамене происходит оценивание учебной деятельности обучающихся по дисциплине на основе полученных оценок за контрольно-рейтинговые мероприятия текущего контроля и промежуточной аттестации. При оценивании результатов учебной деятельности обучающегося по дисциплине используется бально-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179).	Отлично: величина рейтинга обучающегося по дисциплине 85...100 %. Хорошо: величина рейтинга обучающегося по дисциплине 75...84 %. Удовлетворительно: величина рейтинга обучающегося по дисциплине 60...74 %. Неудовлетворительно: величина рейтинга обучающегося по дисциплине 0...59 %.
Доклад	Студент раскрывает тему доклада, анализирует подготовленный материал, делает выводы.	Отлично: студент показывает глубокое знание вопросов темы, свободно

	<p>Преподаватель и слушатели задают вопросы, обсуждаются выявленные проблемы и вырабатывается коллективное решение. Время, отведённое на доклад - 15 минут. При оценивании результатов мероприятия используется бально-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179). Максимальное количество баллов за доклад - 5.</p>	<p>оперирует данными исследования, легко отвечает на поставленные вопросы.</p> <p>Хорошо: студент показывает знание вопросов темы, оперирует данными исследования, без особых затруднений отвечает на поставленные вопросы.</p> <p>Удовлетворительно: студент проявляет неуверенность, показывает слабое знание вопросов темы, не всегда даёт исчерпывающие аргументированные ответы на заданные вопросы.</p> <p>Неудовлетворительно: студент затрудняется ответить на поставленные вопросы по теме, не знает теории вопроса, при ответе допускает существенные ошибки.</p>
Реферат	<p>Студент раскрывает тему реферата, анализирует материал, приводит источники информации, делает выводы. При оценивании результатов мероприятия используется бально-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179). Максимальное количество баллов за реферат - 5.</p>	<p>Отлично: реферат имеет логичное, последовательное изложение материала с соответствующими выводами и обоснованными положениями.</p> <p>Хорошо: реферат имеет последовательное изложение материала, в нём представлен достаточно подробный анализ с соответствующими выводами, однако с не вполне обоснованными положениями.</p> <p>Удовлетворительно: тема реферата раскрыта не полностью, реферат имеет поверхностный анализ, в нём просматривается непоследовательность изложения материала, представлены необоснованные положения.</p> <p>Неудовлетворительно: тема реферата не раскрыта, реферат не имеет анализа, в работе нет выводов либо они имеют декларативный характер.</p>
Тест	<p>При оценивании результатов учебной деятельности обучающегося по дисциплине используется бально-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179). Тест содержит 10 заданий. Максимальная оценка за тест - 10 баллов (за каждый правильный ответ - 1 балл).</p>	<p>Зачтено: тест считается успешно пройденным, если дано не менее 6-ти правильных ответов.</p> <p>Не зачтено: тест не пройден, если дано менее 6-ти правильных ответов.</p>
Бонусное задание	<p>Студент представляет копии документов, подтверждающие победу или участие в предметных олимпиадах по темам дисциплины. При оценивании результатов учебной деятельности обучающегося по дисциплине используется бально-рейтинговая система оценивания результатов учебной деятельности обучающихся (утверждена приказом ректора от 24.05.2019 г. № 179). Максимально возможная величина бонус-рейтинга: +15 %.</p>	<p>Зачтено: +15 % за победу в олимпиаде международного уровня; + 10 % за победу в олимпиаде российского уровня; + 5 % за победу в олимпиаде университетского уровня; + 1 % за участие в олимпиаде</p> <p>Не зачтено: -</p>

7.3. Типовые контрольные задания

Вид контроля	Типовые контрольные задания
Экзамен	Вопросы для подготовки к экзамену Вопросы к экзамену.docx; ФОС Вопросы к экзамену.docx
Доклад	Темы докладов Темы рефератов (докладов).docx
Реферат	Темы рефератов Темы рефератов (докладов).docx
Тест	Вопросы для подготовки к тесту Вопросы теста.doc
Бонусное задание	Перечень мероприятий

8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

Печатная учебно-методическая документация

а) основная литература:

1. 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.
2. 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
3. Матвеев, Б. А. Управление рисками [Текст] курс лекций для бакалавров по направлению "Менеджмент" и др. Б. А. Матвеев ; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Экономика пром-ти и упр. проектами ; ЮУрГУ. - Челябинск: Издательский Центр ЮУрГУ, 2017. - 71, [1] с. ил. электрон. версия

б) дополнительная литература:

1. 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.
2. Управление риском ежекв. журн. Фирма "Анкил" журнал. - М., 1997-
3. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент [Текст] учебник для вузов по экон. направлениям В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский ; Финанс. ун-т при Правительстве Рос. Федерации. - 2-е изд., перераб. и доп. - М.: Юрайт, 2017. - 365 с. ил.
4. Риск-менеджмент инвестиционного проекта [Текст] учебник для вузов по экон. специальностям М. В. Грачева и др.; под ред. М. В. Грачевой, А. Б. Секерина. - М.: ЮНИТИ, 2009. - 544 с.
5. Воронцовский, А. В. Управление рисками [Текст] учебник и практикум для вузов по экон. направлениям и специальностям А. В. Воронцовский ; С.-Петербург. гос. ун-т. - М.: Юрайт, 2017. - 413, [1] с. ил.
6. Рогов, В. А. Управление рисками [Текст] учеб. пособие для вузов по направлению "Конструкт.-технол. обеспечение машиностр. пр-в" В. А. Рогов, А. Д. Чудаков. - Старый Оскол: Тонкие наукоемкие технологии, 2012. - 339 с. рис., табл.

7. Бадалова, А. Г. Управление рисками деятельности предприятия [Текст] учеб. пособие для экон. специальностей вузов по направлению 080200 "Менеджмент" А. Г. Бадалова, А. В. Пантелеев. - 2-е изд. - М.: Вузовская книга, 2016. - 231, [1] с. ил.

8. Риск-менеджмент в коммерческом банке [Текст] коллектив. моногр. И. В. Ларионова и др. ; под ред. И. В. Ларионовой ; ФГОБУ ВПО "Финанс. ун-т при Пр-ве Рос. Федерации". - М.: КноРус, 2014

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. Волкова, А.Г. Управление рисками: методические указания к практическим занятиям и самостоятельной работе [Электронный ресурс] / А.Г. Волкова. - Воронеж: АОНО ВО "Институт менеджмента, маркетинга и финансов", 2015. - 20 с. -
www.immf.ru/upload/Methodicheskoe%20obespechenie/.../МУ_Упр.%20рисками.pdf

из них: учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студента:

2. Волкова, А.Г. Управление рисками: методические указания к практическим занятиям и самостоятельной работе [Электронный ресурс] / А.Г. Волкова. - Воронеж: АОНО ВО "Институт менеджмента, маркетинга и финансов", 2015. - 20 с. -
www.immf.ru/upload/Methodicheskoe%20obespechenie/.../МУ_Упр.%20рисками.pdf

Электронная учебно-методическая документация

№	Вид литературы	Наименование разработки	Наименование ресурса в электронной форме	Доступность (сеть Интернет / локальная сеть; авторизованный / свободный доступ)
1	Основная литература	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	Электронный каталог ЮУрГУ	Интернет / Свободный
2	Дополнительная литература	Шапкин, А.С. Экономические и финансовые риски: Оценка, управление, портфель инвестиций. / А.С. Шапкин, В.А. Шапкин. — М. : Дашков и К, 2016.— 544 с. ; http://e.lanbook.com/book/93337	Электронно-библиотечная система издательства Лань	Интернет / Авторизованный

9. Информационные технологии, используемые при осуществлении образовательного процесса

Перечень используемого программного обеспечения:

1. Microsoft-Windows(бессрочно)
2. Microsoft-Office(бессрочно)

Перечень используемых информационных справочных систем:

Нет

10. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Вид занятий	№ ауд.	Основное оборудование, стенды, макеты, компьютерная техника, предустановленное программное обеспечение, используемое для различных видов занятий
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)
Лекции	265 (3)	Проектор, ноутбук, интерактивная доска
Практические занятия и семинары	264 (2)	Проектор, ноутбук, интерактивная доска