

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Ткачева Татьяна Юрьевна

Должность: декан ФЭиМ

Дата подписания: 07.07.2025 23:16:20

Уникальный программный ключ:

73ec3e90d2fc287e0185b8571569dffca4822a95099bacb11112ac130be77ris

Аннотация к рабочей программе

дисциплины «Управление финансовыми и производственными рисками»

Цель преподавания дисциплины

Целью дисциплины является формирование фундаментальных знаний и практических навыков в области теории и практики принятия управленческих решений в условиях неопределенности внешней среды с целью снижения рисков и обеспечения экономической безопасности. Изучение дисциплины обусловлено необходимостью постигнуть законы и механизмы по определению возможных опасностей, которые могут встретиться в будущей деятельности хозяйствующих субъектов, а главное - эффективного управления таким важнейшим понятием, как риск.

Задачи дисциплины

- получение теоретических знаний в области теории и методологии управления рисками в деятельности хозяйствующего субъекта;
- формирование у студентов практических навыков по оценке источников возможных рисков и по овладению основными методами анализа рисков;
- обучение студентов проведению технико-экономических плановых расчетов и обоснования альтернативных вариантов деятельности предприятия в качестве основы для принятия управленческого решения в условиях риска и неопределенности;
- обучение студентов новейшим методологическим и практическим разработкам в области бизнес-планирования в условиях рыночной экономики;
- получение студентами передового опыта, накопленного в данной области знаний.

Индикаторы компетенций, формируемые в результате освоения дисциплины

- оценивает экономические и социальные условия, риски осуществления предпринимательской деятельности (ПК-4.1);
- применяет методы оценки и управления рисками, методы инвестиционного и финансового анализа для принятия управленческих решений в условиях риска (ПК- 4.2).

Разделы дисциплины

Риски в окружающем нас мире. Риск и неопределенность. Объективное и субъективное понимание риска. Структурные характеристики риска. Риск и информация: фантомные риски. Общесистемная классификация рисков. Классификационные признаки. Специфические классификации рисков. Временные и объектно-территориальные риски. Статические и динамические риски. Особенности возникновения экономических рисков. Организация управления производственным риском. Риски в производственном предпринимательстве. Риски неисполнения хозяйственных договоров (контрактов). Риски усиления конкуренции. Риски возникновения непредвиденных расходов и снижения доходов. Риски потери имущества предпринимательской организации. Система принципов оценки риска. Методологические принципы. Методы экспертного оценивания: историко-ассоциативный, литературно-фантастическая аналогия, концептуальный перенос. Роза рисков. Общесистемная классификация количественных методов анализа и оценки рисков. Абсолютные показатели оценки риска. Относительные показатели оценки риска. Вероятностные показатели оценки риска. Статистические показатели оценки риска. Анализ чувствительности. Компаративный анализ основных концепций управления рисками. Цикл управления риском. Концепция приемлемого риска. Психологические основы управления риском. Психологические основы управления риском. Интегрированный риск – менеджмент. Специфика управления портфелем рисков. Агрегация рисков. Избежание риска. Удержание риска. Диверсификация риска. Распределение риска между участниками проекта. Лимитирование. Страхование. Хеджирование. Резервирование средств на покрытие непредвиденных расходов.

МИНОБРНАУКИ РОССИИ

Юго-Западный государственный университет

УТВЕРЖДАЮ:

Декан факультета

экономики и менеджмента

(наименование ф-та полностью)



Т.Ю. Ткачева

(подпись/инициалы, фамилия)

« 31 » 08 2021 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Управление финансовыми и производственными рисками

(наименование дисциплины)

ОПОП ВО 38.03.02 Менеджмент,

шифр и наименование направления подготовки (специальности)

направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом»

наименование направленности (профиля, специализации)

форма обучения очная

(очная, очно-заочная, заочная)

Курск – 2021

Рабочая программа дисциплины составлена в соответствии с ФГОС ВО – бакалавриат по направлению подготовки (специальности) 38.03.02 Менеджмент на основании учебного плана ОПОП ВО 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом», одобренного Ученым советом университета (протокол № 9 «25» июня 2021 г.).

Рабочая программа дисциплины обсуждена и рекомендована к реализации в образовательном процессе для обучения студентов по ОПОП ВО 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом» на заседании региональной экономики и менеджмента № 7 «21» 08 2021 г.
(наименование кафедры, дата, номер протокола)

И.о. зав. кафедрой Ю.С. Положенцева Положенцева Ю.С.

Разработчик программы
к.э.н., доцент М.Г. Клевцова Клевцова М.Г.
(ученая степень и ученое звание, Ф.И.О.)

/Директор научной библиотеки В.Г. Макаровская Макаровская В.Г.

Рабочая программа дисциплины пересмотрена, обсуждена и рекомендована к реализации в образовательном процессе на основании учебного плана ОПОП ВО 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом», одобренного Ученым советом университета протокол № 9 «25» 06 2021 г., на заседании кафедры региональной экономики и менеджмента № 23 от 05.07.2021.
(наименование кафедры, дата, номер протокола)

Зав. кафедрой, к.э.н., доцент Ю.С. Положенцева Положенцева Ю.С.

Рабочая программа дисциплины пересмотрена, обсуждена и рекомендована к реализации в образовательном процессе на основании учебного плана ОПОП ВО 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом», одобренного Ученым советом университета протокол № 9 «25» 06 2021 г., на заседании кафедры протокол № 20 23.06.2023, каф. РЭиМ.

Зав. кафедрой к.э.н., доцент Ю.С. Положенцева Положенцева Ю.С.

Рабочая программа дисциплины пересмотрена, обсуждена и рекомендована к реализации в образовательном процессе на основании учебного плана ОПОП ВО 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом», одобренного Ученым советом университета протокол № 7 «28» 02 2022 г., на заседании кафедры региональной экономики и менеджмента № 23 от 03.07.2022.

Зав. кафедрой к.э.н., доцент Ю.С. Положенцева Положенцева Ю.С.

Рабочая программа дисциплины пересмотрена, обсуждена и рекомендована к реализации в образовательном процессе на основании учебного плана ОПОП ВО 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом», одобренного Ученым советом университета протокол № 9 «24» 02 2023 г. на заседании кафедры региональной экономики и менеджмента протокол № 23 «24» 06 2025 г.

Зав. кафедрой к.э.н., доцент А.В. Платошечкина Ю.С.

Рабочая программа дисциплины пересмотрена, обсуждена и рекомендована к реализации в образовательном процессе на основании учебного плана ОПОП ВО 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом», одобренного Ученым советом университета протокол № « » 20 г. на заседании кафедры региональной экономики и менеджмента протокол № « » 20 г.

Зав. кафедрой _____

Рабочая программа дисциплины пересмотрена, обсуждена и рекомендована к реализации в образовательном процессе на основании учебного плана ОПОП ВО 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом», одобренного Ученым советом университета протокол № « » 20 г. на заседании кафедры региональной экономики и менеджмента протокол № « » 20 г.

Зав. кафедрой _____

Рабочая программа дисциплины пересмотрена, обсуждена и рекомендована к реализации в образовательном процессе на основании учебного плана ОПОП ВО 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом», одобренного Ученым советом университета протокол № « » 20 г. на заседании кафедры региональной экономики и менеджмента протокол № « » 20 г.

Зав. кафедрой _____

1 Цель и задачи дисциплины. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения основной профессиональной образовательной программы

1.1 Цель дисциплины

Целью дисциплины является формирование фундаментальных знаний и практических навыков в области теории и практики принятия управленческих решений в условиях неопределенности внешней среды с целью снижения рисков и обеспечения экономической безопасности. Изучение дисциплины обусловлено необходимостью постигнуть законы и механизмы по определению возможных опасностей, которые могут встретиться в будущей деятельности хозяйствующих субъектов, а главное - эффективного управления таким важнейшим понятием, как риск.

1.2 Задачи дисциплины

- получение теоретических знаний в области теории и методологии управления рисками в деятельности хозяйствующего субъекта;
- формирование у студентов практических навыков по оценке источников возможных рисков и по овладению основными методами анализа рисков;
- обучение студентов проведению технико-экономических плановых расчетов и обоснования альтернативных вариантов деятельности предприятия в качестве основы для принятия управленческого решения в условиях риска и неопределенности;
- обучение студентов новейшим методологическим и практическим разработкам в области бизнес-планирования в условиях рыночной экономики;
- получение студентами передового опыта, накопленного в данной области знаний.

1.3 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения основной профессиональной образовательной программы

Таблица 1.3 – Результаты обучения по дисциплине

<i>Планируемые результаты освоения основной профессиональной образовательной программы (компетенции, закрепленные за дисциплиной)</i>		<i>Код и наименование индикатора достижения компетенции, закрепленного за дисциплиной</i>	<i>Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с индикаторами достижения компетенций</i>
<i>код компетенции</i>	<i>наименование компетенции</i>		

<i>Планируемые результаты освоения основной профессиональной образовательной программы (компетенции, закрепленные за дисциплиной)</i>		<i>Код и наименование индикатора достижения компетенции, закрепленного за дисциплиной</i>	<i>Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с индикаторами достижения компетенций</i>
<i>код компетенции</i>	<i>наименование компетенции</i>		
ПК-4	Способен оценивать экономические и социальные условия, риски осуществления предпринимательской деятельности, уметь проводить анализ рыночных и специфических рисков при решении задач управления организацией, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании	ПК-4.1 Оценивает экономические и социальные условия, риски осуществления предпринимательской деятельности	Знать: - критерии, применяемые при идентификации риска - методы идентификации риска Уметь: -определять контекст процесса оценки риска в соответствии с внутренней и внешней средой функционирования организации, а также особые обстоятельства и ограничения Владеть (или Иметь опыт деятельности): навыками оценки экономические и социальные условия, риски осуществления предпринимательской деятельности
		ПК- 4.2 Применяет методы оценки и управления рисками, методы инвестиционного и финансового анализа для принятия управленческих решений в условиях риска	Знать: -методы и технологии построения портфеля, реестра, карт, диаграмм и других форм визуального отображения рисков - принципы и правила выбора метода, техники идентификации риска (достаточность ресурсов, характер и степень неопределенности, сложность метода, техники) - возможности инструментов риск-менеджмента для идентификации рисков организации Уметь: - проводить количе-

<i>Планируемые результаты освоения основной профессиональной образовательной программы (компетенции, закрепленные за дисциплиной)</i>		<i>Код и наименование индикатора достижения компетенции, закрепленного за дисциплиной</i>	<i>Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с индикаторами достижения компетенций</i>
<i>код компетенции</i>	<i>наименование компетенции</i>		
			<p>ственную статистическую оценку рисков на основе фактических событий базы рисков событий</p> <p>- определять и применять на практике эффективные методы визуализации рисков организации (в том числе методы построения портфеля, реестра, карты рисков) совместно с ответственными за риск сотрудниками - собственниками риска, оказывать помощь ответственным за риск сотрудникам в правильной идентификации (описании, измерении и оценке) рисков</p> <p><i>Владеть (или Иметь опыт деятельности):</i> навыками управления рисками, методы инвестиционного и финансового анализа для принятия управленческих решений в условиях риска</p>

2 Указание места дисциплины в структуре основной профессиональной образовательной программы

Дисциплина «Управление финансовыми и производственными рисками» входит в часть, формируемую участниками образовательных отношений, основной профессиональной образовательной программы программы – программы бакалавриата 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом». Дисциплина изучается на 3 курсе в 6 семестре.

3 Объем дисциплины в зачетных единицах с указанием количества академических или астрономических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся

Общая трудоемкость (объем) дисциплины составляет 3 зачетные единицы (з.е.), 108 академических часов.

Таблица 3 – Объем дисциплины

Виды учебной работы	Всего, часов
Общая трудоемкость дисциплины	108
Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий (всего)	48
в том числе:	
лекции	16
лабораторные занятия	0
практические занятия	32
Самостоятельная работа обучающихся (всего)	59,9
Контроль (подготовка к экзамену)	0
Контактная работа по промежуточной аттестации (всего АттКР)	0,1
в том числе:	
зачет	0,1
зачет с оценкой	не предусмотрен
курсовая работа (проект)	не предусмотрена
экзамен (включая консультацию перед экзаменом)	не предусмотрен

4 Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий

4.1 Содержание дисциплины

Таблица 4.1.1 – Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам)

№ п/п	Раздел (тема) дисциплины	Содержание
1	2	3
1	Понятие риска:	Риски в окружающем нас мире. Риск и неопределенность. Объективное и субъективное понимание риска. Структурные характеристики риска. Риск и информация: фантомные риски.
2	Общесистемная классификация рисков Экономические риски как объект исследования: Специфические классификации рисков.	Общесистемная классификация рисков. Классификационные признаки. Специфические классификации рисков. Временные и объектно-территориальные риски. Статические и динамические риски. Временные и объектно-территориальные риски. Статические и динамические риски. Особенности возникновения экономических рисков. Производственные и финансовые риски, как часть экономических рисков: Методологические принципы.

3	Принципы и подходы оценки риска. Качественные и количественные методы оценки рисков: Методы экспертного оценивания. Статистические показатели оценки риска. Анализ чувствительности.	Система принципов оценки риска. Методологические принципы. Методические принципы. Операциональные принципы. Функциональные и структурные подходы к оценке риска. Ресурсный подход к оценке риска Методы экспертного оценивания: историко- ассоциативный, литературно-фантастическая аналогия, концептуальный перенос. Роза рисков. Оценка риска с помощью экспертного листа. Метод Дельфи. Методика оценки риска Эксперт-РА. Метод SWOT-анализа. Общесистемная классификация количественных методов анализа и оценки рисков. Абсолютные показатели оценки риска. Относительные показатели оценки риска. Вероятностные показатели оценки риска. Статистические показатели оценки риска. Анализ чувствительности. Анализ сценариев развития проекта. Метод проверки устойчивости. Метод Монте-Карло. Дерево решений. Теория игр в риск-менеджменте. Выбор решений в условиях неопределенности. Критерий Лапласа. Критерий Гурвица. Анализ доходности и риска финансовых операций на основе принципа оптимальности Парето. Процесс оценивания рисков на основе ресурсного подхода
4	Концепции управления риском: Компаративный анализ основных концепций управления рисками. Цикл управления риском. Концепция приемлемого риска. Психологические основы управления риском.	Компаративный анализ основных концепций управления рисками. Цикл управления риском. Концепция приемлемого риска. Психологические основы управления риском. Психологические основы управления риском. Интегрированный риск – менеджмент. Специфика управления портфелем рисков. Агрегация рисков
5	Способы снижения степени риска:	Избежание риска. Удержание риска. Диверсификация риска. Распределение риска между участниками проекта. Лимитирование. Страхование. Хеджирование. Резервирование средств на покрытие непредвиденных расходов.

Таблица 4.1.2 – Содержание дисциплины и его методическое обеспечение

№ п/п	Раздел (тема) дисциплины	Виды деятельности			Учебно-методические материалы	Формы текущего контроля успеваемости (по неделям семестра)	Компетенции
		лек., час	№ лаб.	№ пр.			
1	2	3	4	5	6	7	8
1	Понятие риска:	2		1	У-1-5, МУ-1-2	Т-2	ПК-4
2	Общесистемная классификация рисков Экономические риски	2		2	У-1-5, МУ-1-2	Т-6	ПК-4

	как объект исследования: Специфические классификации рисков						
3	Принципы и подходы оценки риска. Качественные и количественные методы оценки рисков: Методы экспертного оценивания. Статистические показатели оценки риска. Анализ чувствительности.	6		3	У-1-5, МУ-1-2	ПЗ-10	ПК-4
4	Концепции управления риском: Компаративный анализ основных концепций управления рисками. Цикл управления риском. Концепция приемлемого риска. Психологические основы управления риском.	4		4	У-1-5, МУ-1-2	С, Т-12	ПК-4
5	Способы снижения степени риска:	2		5	У-1-5, МУ-1-2	С, Т-16	ПК-4

Т – тестовые задания, ПЗ-производственные задачи, С- ситуационные задачи

4.2 Лабораторные работы и (или) практические занятия

4.2.1 Практические занятия

Таблица 4.2.1 – Практические занятия

№	Наименование практического (семинарского) занятия	Объем, час.
1	Понятие риска	2
2	Общесистемная классификация рисков	2
3	Качественные и количественные методы оценки рисков:	10
4	Концепции управления риском	10
5	Способы снижения степени риска	8
ИТОГО		32

4.3 Самостоятельная работа студентов (СРС)

Таблица 4.3 – Самостоятельная работа студентов

№ раздела (темы)	Наименование раздела (темы) дисциплины	Срок выполнения	Время, затрачиваемое на выполнение СРС, час
1	2	3	4
1.	Понятие риска:	2 неделя	10
2.	Общесистемная классификация рисков Экономические риски как объект исследования: Специфические классификации рисков	4 неделя	10
3.	Принципы и подходы оценки риска. Качественные и количественные методы оценки рисков: Методы экспертного оценивания. Статистические показатели оценки риска. Анализ чувствительности.	8 неделя	10
4.	Концепции управления риском: Компаративный анализ основных концепций управления рисками. Цикл управления риском. Концепция приемлемого риска. Психологические основы управления риском	12 неделя	10
5	Способы снижения степени риска	14 неделя	19,9
Итого			59,9

5 Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

Студенты могут при самостоятельном изучении отдельных тем и вопросов дисциплин пользоваться учебно-наглядными пособиями, учебным оборудованием и методическими разработками кафедры в рабочее время, установленное Правилами внутреннего распорядка работников.

Учебно-методическое обеспечение для самостоятельной работы обучающихся по данной дисциплине организуется:

библиотекой университета:

- библиотечный фонд укомплектован учебной, методической, научной, периодической, справочной и художественной литературой в соответствии с УП и данной РПД;
- имеется доступ к основным информационным образовательным ресурсам, информационной базе данных, в том числе библиографической, возможность выхода в Интернет.

кафедрой:

- путем обеспечения доступности всего необходимого учебно-методического и справочного материала;

- путем предоставления сведений о наличии учебно-методической литературы, современных программных средств.
 - путем разработки:
 - методических рекомендаций, пособий по организации самостоятельной работы студентов;
 - тем рефератов;
 - вопросов к зачету;
 - методических указаний к выполнению лабораторных работ и т.д.
- типографией университета:*
- помощь авторам в подготовке и издании научной, учебной и методической литературы;
 - удовлетворение потребности в тиражировании научной, учебной и методической литературы.

6 Образовательные технологии. Технологии использования воспитательного потенциала дисциплины

Реализация компетентностного подхода предусматривает широкое использование в образовательном процессе активных и интерактивных форм проведения занятий в сочетании с внеаудиторной работой с целью формирования универсальных, общепрофессиональных и профессиональных компетенций обучающихся.

Таблица 6.1 – Интерактивные образовательные технологии, используемые при проведении аудиторных занятий

№	Наименование раздела (темы лекции, практического или лабораторного занятия)	Используемые интерактивные образовательные технологии	Объем, час.
1	2	3	4
1	Лекции раздела «Принципы и подходы оценки риска. Качественные и количественные методы оценки рисков: Методы экспертного оценивания. Статистические показатели оценки риска. Анализ чувствительности.».	Разбор конкретных ситуаций	4
2	Лекции раздела Концепции управления риском: Компаративный анализ основных концепций управления рисками. Цикл управления риском. Концепция приемлемого риска. Психологические основы управления риском	Разбор конкретных ситуаций	4
3	Практическое занятие по теме Качественные и количественные методы оценки рисков	Разбор конкретных ситуаций	6
4	Практическое занятие по теме Концепции управления риском	Разбор конкретных ситуаций	6
5	Практическое занятие по Способы снижения степени риска	Разбор конкретных ситуаций	4
Итого:			24

Содержание дисциплины обладает значительным воспитательным потенциалом, поскольку в нем аккумулирован современный социокультурный опыт человечества. Реализация воспитательного потенциала дисциплины осуществляется в рамках единого образовательного и воспитательного процесса и способствует непрерывному развитию личности каждого обучающегося. Дисциплина вносит значимый вклад в формирование общей культуры обучающихся. Содержание дисциплины способствует духовно-нравственному, экономическому, профессионально-трудовому, воспитанию обучающихся).

Реализация воспитательного потенциала дисциплины подразумевает:

– целенаправленный отбор преподавателем и включение в лекционный материал, материал для практических и (или) лабораторных занятий содержания, демонстрирующего обучающимся образцы настоящего научного подвижничества создателей и представителей данной отрасли науки (производства, экономики, культуры), высокого профессионализма ученых (представителей производства, деятелей культуры), их ответственности за результаты и последствия деятельности для природы, человека и общества; примеры подлинной нравственности людей, причастных к развитию науки, экономики и производства, а также примеры высокой духовной культуры, гуманизма, творческого мышления;

– применение технологий, форм и методов преподавания дисциплины, имеющих высокий воспитательный эффект за счет создания условий для взаимодействия обучающихся с преподавателем, другими обучающимися, представителями работодателей (деловые игры, разбор конкретных ситуаций, решение кейсов, и др.);

– личный пример преподавателя, демонстрацию им в образовательной деятельности и общении с обучающимися за рамками образовательного процесса высокой общей и профессиональной культуры.

Реализация воспитательного потенциала дисциплины на учебных занятиях направлена на поддержание в университете единой развивающей образовательной и воспитательной среды. Реализация воспитательного потенциала дисциплины в ходе самостоятельной работы обучающихся способствует развитию в них целеустремленности, инициативности, креативности, ответственности за результаты своей работы – качеств, необходимых для успешной социализации и профессионального становления.

7 Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

7.1 Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения основной профессиональной образовательной программы

Таблица 7.1 – Этапы формирования компетенций

Код и наименование компетенции	Этапы* формирования компетенций и дисциплины (модули) и практики, при изучении/ прохождении которых формируется данная компетенция		
	начальный	основной	завершающий
1	2	3	4
ПК-4 Способен оценивать экономические и социальные условия, риски осуществления предпринимательской деятельности, уметь проводить анализ рыночных и специфических рисков при решении задач управления организацией, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании	Управление капитальными вложениями Организация предпринимательской деятельности Региональные аспекты управления бизнесом Проекты государственно-частного партнерства в регионе Производственная технологическая (проектно-технологическая) практика Оценка бизнеса и управление стоимостью компании		Производственная преддипломная практика Выполнение и защита выпускной квалификационной работы

*Этапы для РПД всех форм обучения определяются по учебному плану очной формы обучения следующим образом:

Этап	Учебный план очной формы обучения / семестр изучения дисциплины		
	Бакалавриат	Специалитет	Магистратура
<i>Начальный</i>	1-3 семестры	1-3 семестры	1 семестр
<i>Основной</i>	4-6 семестры	4-6 семестры	2 семестр
<i>Завершающий</i>	7-8 семестры	7-10 семестры	3-4 семестры

** Если при заполнении таблицы обнаруживается, что *один или два этапа* не обеспечены дисциплинами, практиками, НИР, необходимо:

- при наличии дисциплин, изучающихся в разных семестрах, – распределить их по этапам в зависимости от № семестра изучения (начальный этап соответствует более раннему семестру, основной и завершающий – более поздним семестрам);

- при наличии дисциплин, изучающихся в одном семестре, – все дисциплины указать для всех этапов.

7.2 Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

Таблица 7.2 – Показатели и критерии оценивания компетенций, шкала оценивания

Код компетенции/ этап (указывается название этапа из п.7.1)	Показатели оценивания компетенций (индикаторы достижения компетенций, закрепленные за дисциплиной)	Критерии и шкала оценивания компетенций		
		Пороговый уровень («удовлетворительно»)	Продвинутый уровень (хорошо)	Высокий уровень («отлично»)
1	2	3	4	5
ПК-4 основной, завершающий	<p>ПК- 4.1 Оценивает экономические и социальные условия, риски осуществления предпринимательской деятельности</p> <p>ПК – 4.2 Применяет методы оценки и управления рисками, методы инвестиционного и финансового анализа для принятия управленческих решений в условиях риска</p>	<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> - критерии, применяемые при идентификации риска - методы идентификации риска -методы и технологии построения портфеля, реестра, карт, диаграмм и других форм визуального отображения рисков <p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> - проводить количественную статистическую оценку рисков на основе фактических событий базы рисков событий <p>Владеть (или Иметь опыт деятельности):</p> <p>навыками оценки эконо-</p>	<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> - критерии, применяемые при идентификации риска - методы идентификации риска -методы и технологии построения портфеля, реестра, карт, диаграмм и других форм визуального отображения рисков <p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> -определять контекст процесса оценки риска в соответствии с внутренней и внешней средой функционирования организации, а также особые обстоятельства и ограничения - проводить количественную статистическую оценку рисков на основе фактических событий базы рисков событий <p>Владеть (или Иметь опыт деятельности):</p> <p>навыками оценки экономических и со-</p>	<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> - критерии, применяемые при идентификации риска - методы идентификации риска -методы и технологии построения портфеля, реестра, карт, диаграмм и других форм визуального отображения рисков - принципы и правила выбора метода, техники идентификации риска (достаточность ресурсов, характер и степень неопределенности, сложность метода, техники) - возможности инструментов риск-менеджмента для идентификации рисков организации <p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> -определять контекст процесса оценки риска в соответствии с внутренней и внешней средой функционирования организации, а также особые обстоятельства и ограничения

Код компетенции/ этап (указывается название этапа из п. 7.1)	Показатели оценивания компетенций (индикаторы достижения компетенций, закрепленные за дисциплиной)	Критерии и шкала оценивания компетенций		
		Пороговый уровень («удовлетворительно»)	Продвинутый уровень (хорошо)	Высокий уровень («отлично»)
1	2	3	4	5
		<p>мические и социальные условия, риски осуществления предпринимательской деятельности</p>	<p>циальные условия, риски осуществления предпринимательской деятельности навыками управления рисками, методы инвестиционного и финансового анализа для принятия управленческих решений в условиях риска</p>	<p>- проводить количественную статистическую оценку рисков на основе фактических событий базы рисков событий - определять и применять на практике эффективные методы визуализации рисков организации (в том числе методы построения портфеля, реестра, карты рисков) совместно с ответственными за риск сотрудниками - собственниками риска, оказывать помощь ответственным за риск сотрудникам в правильной идентификации (описании, измерении и оценке) рисков</p> <p>Владеть (или Иметь опыт деятельности): навыками оценки экономические и социальные условия, риски осуществления предпринимательской деятельности навыками управления рисками, методы инвестиционного и финансового анализа для принятия управленческих решений в</p>

Код компетенции/ этап (указывается название этапа из п.7.1)	Показатели оценивания компетенций (индикаторы достижения компетенций, закрепленные за дисциплиной)	Критерии и шкала оценивания компетенций		
		Пороговый уровень («удовлетворительно»)	Продвинутый уровень (хорошо)	Высокий уровень («отлично»)
1	2	3	4	5
				условиях риска

7.3 Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения основной профессиональной образовательной программы

Таблица 7.3 - Паспорт комплекта оценочных средств для текущего контроля успеваемости

№ п/п	Раздел (тема) дисциплины	Код контролируемой компетенции (или ее части)	Технология формирования	Оценочные средства		Описание шкал оценивания
				наименование	№№ заданий	
1	2	3	4	5	6	7
1	Понятие риска:	ПК-4.1, ПК-4.2	Лекция, СРС, практическое занятие	Тесты	1-20	Согласно табл.7.2
2	Общесистемная классификация рисков Экономические риски как объект исследования: Специфические классификации рисков	ПК-4.1, ПК-4.2	Лекция, СРС, практическое занятие	Тесты	1-20	Согласно табл.7.2
3	Принципы и подходы оценки риска. Качественные и количественные методы оценки рисков: Методы экспертного оценивания. Статистические	ПК-4.1, ПК-4.2	Лекция, СРС, практическое занятие	Задачи	1-10	Согласно табл.7.2

№ п/п	Раздел (тема) дисциплины	Код контролируемой компетенции (или ее части)	Технология формирования	Оценочные средства		Описание шкал оценивания
				наименование	№№ заданий	
1	2	3	4	5	6	7
	показатели оценки риска. Анализ чувствительности.					
4	Концепции управления риском: Сравнительный анализ основных концепций управления рисками. Цикл управления риском. Концепция приемлемого риска. Психологические основы управления риском	ПК-4.1, ПК-4.2	Лекция, СРС, практическое занятие	Тесты	1-20	Согласно табл.7.2
				Ситуационные задачи	1-3	
5	Способы снижения степени риска	ПК-4.1, ПК-4.2	Лекция, СРС, практическое занятие	Тесты	1-20	Согласно табл.7.2
				Ситуационные задачи	1-3	

Примеры типовых контрольных заданий для проведения текущего контроля успеваемости

Вопрос тестового задания по теме 1

Риск – это:

- 1 неблагоприятное событие, влекущее за собой убыток
- 2 все предпосылки, могущие негативно повлиять на достижение стратегических целей в течение строго определенного временного промежутка
- 3 вероятность наступления стихийных бедствий либо технических аварий
- 4 вероятность провала программы продаж

Пример задачи по теме 3

Рассматриваются два инвестиционных проекта. Первый с вероятностью 0,65 обеспечивает доход в 10 млн руб., однако с вероятностью 0,35 убытки могут составить 6 млн. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,7 можно получить доход 8 млн. руб., с

вероятностью 0,3 убытки 4 млн. руб. Какой из проектов следует реализовать? Ответ аргументировать.

Типовые задания для проведения промежуточной аттестации обучающихся

Промежуточная аттестация по дисциплине проводится в форме зачета. Зачет проводится в форме тестирования (бланкового и/или компьютерного).

Для тестирования используются контрольно-измерительные материалы (КИМ) – вопросы и задания в тестовой форме, составляющие банк тестовых заданий (БТЗ) по дисциплине, утвержденный в установленном в университете порядке.

Проверяемыми на промежуточной аттестации элементами содержания являются темы дисциплины, указанные в разделе 4 настоящей программы. Все темы дисциплины отражены в КИМ в равных долях (%). БТЗ включает в себя не менее 100 заданий и постоянно пополняется. БТЗ хранится на бумажном носителе в составе УММ и электронном виде в ЭИОС университета.

Для проверки *знаний* используются вопросы и задания в различных формах:

- закрытой (с выбором одного или нескольких правильных ответов),
- открытой (необходимо вписать правильный ответ),
- на установление правильной последовательности,
- на установление соответствия.

Умения, навыки (или опыт деятельности) и компетенции проверяются с помощью компетентностно-ориентированных задач (ситуационных, производственных или кейсового характера) и различного вида конструкторов.

Все задачи являются многоходовыми. Некоторые задачи, проверяющие уровень сформированности компетенций, являются многовариантными. Часть умений, навыков и компетенций прямо не отражена в формулировках задач, но они могут быть проявлены обучающимися при их решении.

В каждый вариант КИМ включаются задания по каждому проверяемому элементу содержания во всех перечисленных выше формах и разного уровня сложности. Такой формат КИМ позволяет объективно определить качество освоения обучающимися основных элементов содержания дисциплины и уровень сформированности компетенций.

Примеры типовых заданий для проведения промежуточной аттестации обучающихся

Задание в закрытой форме:

Управление риском – это:

- 1 отказ от рискованного проекта
- 2 комплекс мер, направленных на снижение вероятности реализации риска
- 3 комплекс мер, направленных на компенсацию, снижение, перенесение, принятиериска или уход от него
- 4 комплекс мероприятий, направленных на подготовку к реализации риска

Задание в открытой форме:

Карта рисков - это?

Задание на установление правильной последовательности,

Выявить последовательность действий:

- 1.Выявление расхождений в альтернативах риска
- 2 разработка конкретных мероприятий, направленных на минимизацию или устранение негативных последствий
- 3 учет психологического восприятия рискованных проектов

Задание на установление соответствия:

Соотнесите понятия и их характеристику

Виды логистики	Характеристика
Риск	комплекс мер, направленных на компенсацию, снижение, перенесение, принятиериска или уход от него
Управление риском	парадигма стоимости риска
VAR	все предпосылки, могущие негативно повлиять на достижение стратегических целей в течение строго определенного временного промежутка
Волатильность	изменчивость рыночного спроса

Компетентностно-ориентированная задача:

Компания «Крокус» занимается производством оборудования для химической промышленности. Руководством компании было принято решение расширить ассортимент своей продукции, добавив его техникой с новой технологией. Разработать карту рисков для этого проекта.

Полностью оценочные материалы и оценочные средства для проведения промежуточной аттестации обучающихся представлены в УММ по дисциплине.

7.4 Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций

Процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций, регулируются следующими нормативными актами университета:

– положение П 02.016 «О балльно-рейтинговой системе оценивания результатов обучения по дисциплинам (модулям) и практикам при освоении обучающимися образовательных программ»;

– методические указания, используемые в образовательном процессе, указанные в списке литературы.

Для *текущего контроля успеваемости* по дисциплине в рамках действующей в университете балльно-рейтинговой системы применяется следующий порядок начисления баллов:

Таблица 7.4 – Порядок начисления баллов в рамках БРС

Форма контроля	Минимальный балл		Максимальный балл	
	балл	примечание	балл	примечание
1	2	3	4	5
Понятие риска:	2	Выполнил, менее 50%	4	Выполнил, более 50%
Общесистемная классификация рисков Экономические риски как объект исследования: Специфические классификации рисков	2	Выполнил, менее 50%	4	Выполнил, более 50%
Принципы и подходы оценки риска. Качественные и количественные методы оценки рисков: Методы экспертного оценивания. Статистические показатели оценки риска. Анализ чувствительности.	2	Выполнил, менее 50%	4	Выполнил, более 50%
Концепции управления риском: Компаративный анализ основных концепций управления рисками. Цикл управления риском. Концепция приемлемого риска. Психологические основы управления риском	4	Выполнил, менее 50%	8	Выполнил, более 50%
Способы снижения степени риска	2	Выполнил, менее 50%	4	Выполнил, более 50%
СРС	12		24	
Итого	24		48	
Посещаемость	0		16	
Зачет	0		36	
Итого	24		100	

Для *промежуточной аттестации обучающихся*, проводимой в виде тестирования, используется следующая методика оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности. В каждом варианте КИМ –16 заданий (15 вопросов и одна задача).

Каждый верный ответ оценивается следующим образом:

- задание в закрытой форме – 2 балла,
 - задание в открытой форме – 2 балла,
 - задание на установление правильной последовательности – 2 балла,
 - задание на установление соответствия – 2 балла,
 - решение компетентностно-ориентированной задачи – 6 баллов.
- Максимальное количество баллов за тестирование – 36 баллов.

8 Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

8.1 Основная учебная литература

1. Каранина, Е. В. Управление рисками: механизмы, инструменты, профессиональные стандарты : / Е. В. Каранина. – Москва ; Берлин : Директ-Медиа, 2020. – 257 с. : ил., табл., схем. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=576521> (дата обращения: 21.08.2021). – Библиогр. в кн. – ISBN 978-5-4499-1161-2. – DOI 10.23681/576521. – Текст : электронный.

2. Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент : учебник / А. Н. Фомичев. – 7-е изд. – Москва : Дашков и К°, 2020. – 372 с. : ил. – (Учебные издания для бакалавров). – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=573397> (дата обращения: 21.08.2021). – Библиогр. в кн. – ISBN 978-5-394-03820-4. – Текст : электронный.

8.2 Дополнительная учебная литература

3. Киселев, А. А. Риск-менеджмент в управлении организациями: учебник для бакалавриата : / А. А. Киселев. – Москва ; Берлин : Директ-Медиа, 2019. – 173 с. : ил., схем. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=575459> (дата обращения: 21.08.2021). – Библиогр.: с. 157-158. – ISBN 978-5-4499-0851-3. – Текст : электронный.

4. Марченко, Б. И. Анализ риска: основы управления рисками : / Б. И. Марченко ; Южный федеральный университет. – Ростов-на-Дону ; Таганрог : Южный федеральный университет, 2019. – 123 с. : ил. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=577781> (дата обращения: 21.08.2021). – Библиогр. в кн. – ISBN 978-5-9275-3124-0. – Текст : электронный.

5. Шапкин, А. С. Экономические и финансовые риски: оценка, управление, портфель инвестиций : / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. – 9-е изд. – Москва : Дашков и К°, 2018. – 544 с. : ил. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=496079> (дата обращения:

21.08.2021). – Библиогр.: с. 531-536. – ISBN 978-5-394-02150-3. – Текст : электронный.

8.3 Перечень методических указаний

1. Управление финансовыми и производственными рисками [Электронный ресурс] : методические рекомендации по проведению практических занятий / Юго-Зап. гос. ун-т ; сост. М.Г. Клевцова. - Курск : ЮЗГУ, 2021. - 18 с.

2. Управление финансовыми и производственными рисками [Электронный ресурс] : методические рекомендации для самостоятельной работы / Юго-Зап. гос. ун-т ; сост. М.Г. Клевцова. - Курск : ЮЗГУ, 2021. – 28 с.

8.4 Другие учебно-методические материалы

При изучении дисциплины используются персональные компьютеры, могут быть применены демоверсии программных продуктов. В качестве источника информации используются справочные правовые системы «Консультант-Плюс» и «Гарант

Журналы (периодические издания):

1. Известия ЮЗГУ.
2. Известия ЮЗГУ. Серия: Экономика. Социология. Менеджмент.
3. Вопросы статистики.
4. Вопросы экономики.
5. Инновации.
7. Менеджмент в России и за рубежом.
8. Маркетинг в России и за рубежом.
9. Эксперт РА.
11. Российский экономический журнал.

9 Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины

Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети:

1. Научная библиотека Юго-Западного государственного университета -

<http://www.lib.swsu.ru/2011-02-23-15-22-58/2012-08-30-06-40-55.html>

2. Электронно-библиотечная система «Университетская библиотека онлайн» - <http://biblioclub.ru>

3. Научная электронная библиотека eLibrary.ru (официальный сайт) - <http://elibrary.ru>

4. База данных рефератов и цитирования «Scopus» - <http://www.scopus.com>

5. Электронная библиотека диссертаций и авторефератов РГБ - <http://dvs.rsl.ru/>
6. Официальный сайт Минэкономразвития РФ - www.economy.gov.ru
7. Справочно-поисковая система КонсультантПлюс - www.consultant.ru
8. Электронно-библиотечная система «Лань» - <http://e.lanbook.com/>
9. Образовательный ресурс «Единое окно» - <http://window.edu.ru/>
10. Научно-информационный портал ВINITI РАН - <http://viniti.ru>

10 Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Основными видами аудиторной работы студента при изучении дисциплины «Управление финансовыми и производственными рисками» являются лекции и лабораторные занятия. Студент не имеет права пропускать занятия без уважительных причин.

На лекциях излагаются и разъясняются основные понятия темы, связанные с ней теоретические и практические проблемы, даются рекомендации для самостоятельной работы. В ходе лекции студент должен внимательно слушать и конспектировать материал.

Изучение наиболее важных тем или разделов дисциплины завершают лабораторные занятия, которые обеспечивают контроль подготовленности студента; закрепление учебного материала; приобретение опыта устных публичных выступлений, ведения дискуссии, в том числе аргументации и защиты выдвигаемых положений и тезисов.

Лабораторному занятию предшествует самостоятельная работа студента, связанная с освоением материала, полученного на лекциях, и материалов, изложенных в учебниках и учебных пособиях, а также литературе, рекомендованной преподавателем.

По согласованию с преподавателем или по его заданию студенты готовят рефераты по отдельным темам дисциплины, выступают на занятиях с докладами. Основу докладов составляет, как правило, содержание подготовленных студентами рефератов.

Качество учебной работы студентов преподаватель оценивает по результатам тестирования, собеседования, защиты отчетов по лабораторным работам, а также по результатам докладов.

Преподаватель уже на первых занятиях объясняет студентам, какие формы обучения следует использовать при самостоятельном изучении дисциплины «Управление финансовыми и производственными рисками»: конспектирование учебной литературы и лекции, составление словарей понятий и терминов и т. п.

В процессе обучения преподаватели используют активные формы работы со студентами: чтение лекций, привлечение студентов к творческому процессу на лекциях, отработку студентами пропущенных лекций, участие

в групповых и индивидуальных консультациях (собеседовании). Эти формы способствуют выработке у студентов умения работать с учебником и литературой. Изучение литературы составляет значительную часть самостоятельной работы студента. Это большой труд, требующий усилий и желания студента. В самом начале работы над книгой важно определить цель и направление этой работы. Прочитанное следует закрепить в памяти. Одним из приемов закрепления освоенного материала является конспектирование, без которого немыслима серьезная работа над литературой. Систематическое конспектирование помогает научиться правильно, кратко и четко излагать своими словами прочитанный материал.

Самостоятельную работу следует начинать с первых занятий. От занятия к занятию нужно регулярно прочитывать конспект лекций, знакомиться с соответствующими разделами учебника, читать и конспектировать литературу по каждой теме дисциплины. Самостоятельная работа дает студентам возможность равномерно распределить нагрузку, способствует более глубокому и качественному освоению учебного материала. В случае необходимости студенты обращаются за консультацией к преподавателю по вопросам дисциплины «Управление финансовыми и производственными рисками» с целью освоения и закрепления компетенций.

Основная цель самостоятельной работы студента при изучении дисциплины «Управление финансовыми и производственными рисками» - закрепить теоретические знания, полученные в процессе лекционных занятий, а также сформировать практические навыки самостоятельного анализа особенностей дисциплины.

11 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости)

1. MSDN subscriptions: Windows 7, Windows 8, Windows 10 (Договор IT000012385)
2. Microsoft Office
 - Office 2007 Suites WG33Y-HW9V4-HYYT6-RKXQC-9G94T
 - Office Standard 2010 MAK MM4WT-7XGV2-3DW28-KYQQK-3648H
 - Office Std 2013 MAK NBYTG-R4MCC-27CMM-MQCKY-HT7VT
 - Office Standard 2016 MAK K69RB-GWNJC-BQMFC-C6F2D-RJRJC
3. Справочно-правовая система «Консультант +» (договор №219894 от 25.12.2017 г.)
4. Свободно распространяемое и бесплатное ПО:
 - LibreOffice (<https://ru.libreoffice.org/download/>)
 - OpenOffice (<https://ru.libreoffice.org/download/>)

12 Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине

Учебная аудитория для проведения занятий, а также лаборатория (компьютерный класс) кафедры региональной экономики и менеджмента оснащена учебной мебелью: столы и стулья для обучающихся; стол и стул для преподавателя; доска.

При изучении дисциплины используются компьютеры (компьютерный класс – аудитория а-40), проекторы и т.д., в частности:

- Системные блоки учащихся HELIOProficeVL310. клавиат.мышь, предустанов. ПОMicrosoftoffice 2003 Pro Rus;
- Мониторы 15"TFT Proview;
- PKS1155 Intel i3-2130 3.4 Hz / DDR III-4Gb / HDD SATA III 320 Gb / DVD + R/RW, 23" LCD Samsung;
- ЭкранScreen Media Apollo 153×203 наштативе;
- Мультимедиацентр: ноутбукASUS X50VL PMD-T2330/14"/1024Mb/160Gb/сумка / проекторinFocus IN24+ (2 шт.);
- Проектор VivitekD517;
- Моторизованный экран для формирования отчетной документации и демонстрации итоговых результатов.

В компьютерном классе кафедры региональной экономики и менеджмента обеспечена доступность студентам к сети Интернет.

Вуз обеспечен необходимым комплектом лицензионного программного обеспечения: стандартные программные продукты, Справочно-правовая система «КонсультантПлюс». При проведении лекционных занятий с целью лучшего восприятия студентами учебного материала используются наглядные формы представления информации в виде слайдов. Для этих целей применяется персональный компьютер (ноутбук), мультимедиа проектор, экран.

13 Особенности реализации дисциплины для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья

При обучении лиц с ограниченными возможностями здоровья учитываются их индивидуальные психофизические особенности. Обучение инвалидов осуществляется также в соответствии с индивидуальной программой реабилитации инвалида (при наличии).

Для лиц с нарушением слуха возможно предоставление учебной информации в визуальной форме (краткий конспект лекций; тексты заданий, напечатанные увеличенным шрифтом), на аудиторных занятиях допускается присутствие ассистента, а также сурдопереводчиков и тифлосурдопереводчиков. Текущий контроль успеваемости осуществляется в письменной форме: обучающийся письменно отвечает на вопросы, письменно выполняет практические задания. Доклад (реферат) также может быть представлен в

письменной форме, при этом требования к содержанию остаются теми же, а требования к качеству изложения материала (понятность, качество речи, взаимодействие с аудиторией и т. д.) заменяются на соответствующие требования, предъявляемые к письменным работам (качество оформления текста и списка литературы, грамотность, наличие иллюстрационных материалов и т.д.). Промежуточная аттестация для лиц с нарушениями слуха проводится в письменной форме, при этом используются общие критерии оценивания. При необходимости время подготовки к ответу может быть увеличено.

Для лиц с нарушением зрения допускается аудиальное предоставление информации, а также использование на аудиторных занятиях звукозаписывающих устройств (диктофонов и т.д.). Допускается присутствие на занятиях ассистента (помощника), оказывающего обучающимся необходимую техническую помощь. Текущий контроль успеваемости осуществляется в устной форме. При проведении промежуточной аттестации для лиц с нарушением зрения тестирование может быть заменено на устное собеседование по вопросам.

Для лиц с ограниченными возможностями здоровья, имеющих нарушения опорно-двигательного аппарата, на аудиторных занятиях, а также при проведении процедур текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации могут быть предоставлены необходимые технические средства (персональный компьютер, ноутбук или другой гаджет); допускается присутствие ассистента (ассистентов), оказывающего обучающимся необходимую техническую помощь (занять рабочее место, передвигаться по аудитории, прочитать задание, оформить ответ, общаться с преподавателем).

МИНОБРНАУКИ РОССИИ

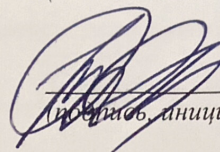
Юго-Западный государственный университет

УТВЕРЖДАЮ:

Декан факультета

экономики и менеджмента

(наименование ф-та полностью)



Т.Ю. Ткачева

(подпись, инициалы, фамилия)

« 31 » 08 2021 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Управление финансовыми и производственными рисками

(наименование дисциплины)

ОПОП ВО 38.03.02 Менеджмент,

шифр и наименование направления подготовки (специальности)

направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом»

наименование направленности (профиля, специализации)

форма обучения очно-заочная

(очная, очно-заочная, заочная)

Курс – 2021

Рабочая программа дисциплины составлена в соответствии с ФГОС ВО – бакалавриат по направлению подготовки (специальности) 38.03.02 Менеджмент на основании учебного плана ОПОП ВО 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом», одобренного Ученым советом университета (протокол № 9 «25» июня 2021 г.).

Рабочая программа дисциплины обсуждена и рекомендована к реализации в образовательном процессе для обучения студентов по ОПОП ВО 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом» на заседании региональной экономики и менеджмента № 7 «21» 08 2021 г.
(наименование кафедры, дата, номер протокола)

И.о. зав. кафедрой Ю.С. Положенцева Положенцева Ю.С.

Разработчик программы
к.э.н., доцент М.Г. Клевцова Клевцова М.Г.
(ученая степень и ученое звание, Ф.И.О.)

/Директор научной библиотеки В.Г. Макаровская Макаровская В.Г.

Рабочая программа дисциплины пересмотрена, обсуждена и рекомендована к реализации в образовательном процессе на основании учебного плана ОПОП ВО 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом», одобренного Ученым советом университета протокол № 9 «25» 06 2021 г., на заседании кафедры региональной экономики и менеджмента № 23 от 05.07.2021.
(наименование кафедры, дата, номер протокола)

Зав. кафедрой, к.э.н., доцент Ю.С. Положенцева Положенцева Ю.С.

Рабочая программа дисциплины пересмотрена, обсуждена и рекомендована к реализации в образовательном процессе на основании учебного плана ОПОП ВО 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом», одобренного Ученым советом университета протокол № 9 «25» 06 2021 г., на заседании кафедры протокол № 20 23.06.2023, каф. РЭиМ.

Зав. кафедрой к.э.н., доцент Ю.С. Положенцева Положенцева Ю.С.

Рабочая программа дисциплины пересмотрена, обсуждена и рекомендована к реализации в образовательном процессе на основании учебного плана ОПОП ВО 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом», одобренного Ученым советом университета протокол № 7 «28» 02 2022 г., на заседании кафедры региональной экономики и менеджмента № 23 от 03.07.2022.

Зав. кафедрой к.э.н., доцент Ю.С. Положенцева Положенцева Ю.С.

Рабочая программа дисциплины пересмотрена, обсуждена и рекомендована к реализации в образовательном процессе на основании учебного плана ОПОП ВО 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом», одобренного Ученым советом университета протокол № 9 «24» 02 2023 г. на заседании кафедры региональной экономики и менеджмента протокол № 23 «24» 06 2025 г.

Зав. кафедрой к.э.н., доцент А.В. Платошечкина Ю.С.

Рабочая программа дисциплины пересмотрена, обсуждена и рекомендована к реализации в образовательном процессе на основании учебного плана ОПОП ВО 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом», одобренного Ученым советом университета протокол № __ «__» ____ 20__ г. на заседании кафедры региональной экономики и менеджмента протокол № __ «__» ____ 20__ г.

Зав. кафедрой _____

Рабочая программа дисциплины пересмотрена, обсуждена и рекомендована к реализации в образовательном процессе на основании учебного плана ОПОП ВО 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом», одобренного Ученым советом университета протокол № __ «__» ____ 20__ г. на заседании кафедры региональной экономики и менеджмента протокол № __ «__» ____ 20__ г.

Зав. кафедрой _____

Рабочая программа дисциплины пересмотрена, обсуждена и рекомендована к реализации в образовательном процессе на основании учебного плана ОПОП ВО 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом», одобренного Ученым советом университета протокол № __ «__» ____ 20__ г. на заседании кафедры региональной экономики и менеджмента протокол № __ «__» ____ 20__ г.

Зав. кафедрой _____

1 Цель и задачи дисциплины. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения основной профессиональной образовательной программы

1.1 Цель дисциплины

Целью дисциплины является формирование фундаментальных знаний и практических навыков в области теории и практики принятия управленческих решений в условиях неопределенности внешней среды с целью снижения рисков и обеспечения экономической безопасности. Изучение дисциплины обусловлено необходимостью постигнуть законы и механизмы по определению возможных опасностей, которые могут встретиться в будущей деятельности хозяйствующих субъектов, а главное - эффективного управления таким важнейшим понятием, как риск.

1.2 Задачи дисциплины

- получение теоретических знаний в области теории и методологии управления рисками в деятельности хозяйствующего субъекта;
- формирование у студентов практических навыков по оценке источников возможных рисков и по овладению основными методами анализа рисков;
- обучение студентов проведению технико-экономических плановых расчетов и обоснования альтернативных вариантов деятельности предприятия в качестве основы для принятия управленческого решения в условиях риска и неопределенности;
- обучение студентов новейшим методологическим и практическим разработкам в области бизнес-планирования в условиях рыночной экономики;
- получение студентами передового опыта, накопленного в данной области знаний.

1.3 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения основной профессиональной образовательной программы

Таблица 1.3 – Результаты обучения по дисциплине

<i>Планируемые результаты освоения основной профессиональной образовательной программы (компетенции, закрепленные за дисциплиной)</i>		<i>Код и наименование индикатора достижения компетенции, закрепленного за дисциплиной</i>	<i>Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с индикаторами достижения компетенций</i>
<i>код компетенции</i>	<i>наименование компетенции</i>		

<i>Планируемые результаты освоения основной профессиональной образовательной программы (компетенции, закрепленные за дисциплиной)</i>		<i>Код и наименование индикатора достижения компетенции, закрепленного за дисциплиной</i>	<i>Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с индикаторами достижения компетенций</i>
<i>код компетенции</i>	<i>наименование компетенции</i>		
ПК-4	Способен оценивать экономические и социальные условия, риски осуществления предпринимательской деятельности, уметь проводить анализ рыночных и специфических рисков при решении задач управления организацией, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании	ПК-4.1 Оценивает экономические и социальные условия, риски осуществления предпринимательской деятельности	<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> - критерии, применяемые при идентификации риска - методы идентификации риска <p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> -определять контекст процесса оценки риска в соответствии с внутренней и внешней средой функционирования организации, а также особые обстоятельства и ограничения <p>Владеть (или Иметь опыт деятельности):</p> <ul style="list-style-type: none"> навыками оценки экономические и социальные условия, риски осуществления предпринимательской деятельности
		ПК- 4.2 Применяет методы оценки и управления рисками, методы инвестиционного и финансового анализа для принятия управленческих решений в условиях риска	<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> -методы и технологии построения портфеля, реестра, карт, диаграмм и других форм визуального отображения рисков - принципы и правила выбора метода, техники идентификации риска (достаточность ресурсов, характер и степень неопределенности, сложность метода, техники) - возможности инструментов риск-менеджмента для идентификации рисков организации <p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> - проводить количественную статистическую оценку рисков на основе фактических со-

<i>Планируемые результаты освоения основной профессиональной образовательной программы (компетенции, закрепленные за дисциплиной)</i>		<i>Код и наименование индикатора достижения компетенции, закрепленного за дисциплиной</i>	<i>Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с индикаторами достижения компетенций</i>
<i>код компетенции</i>	<i>наименование компетенции</i>		
			<p>бытий базы рисков событий</p> <p>- определять и применять на практике эффективные методы визуализации рисков организации (в том числе методы построения портфеля, рестра, карты рисков) совместно с ответственными за риск сотрудниками -собственниками риска, оказывать помощь ответственному за риск сотрудникам в правильной идентификации (описании, измерении и оценке) рисков</p> <p><i>Владеть (или Иметь опыт деятельности):</i> навыками управления рисками, методы инвестиционного и финансового анализа для принятия управленческих решений в условиях риска</p>

2 Указание места дисциплины в структуре основной профессиональной образовательной программы

Дисциплина «Управление финансовыми и производственными рисками» входит в часть, формируемую участниками образовательных отношений, основной профессиональной образовательной программы программы – программы бакалавриата 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль, специализация) «Управление бизнесом». Дисциплина изучается на 3 курсе в 6 семестре.

3 Объем дисциплины в зачетных единицах с указанием количества академических или астрономических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся

Общая трудоемкость (объем) дисциплины составляет 3 зачетные единицы (з.е.), 108 академических часов.

Таблица 3 – Объем дисциплины

Виды учебной работы	Всего, часов
Общая трудоемкость дисциплины	108
Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий (всего)	24
в том числе:	
лекции	8
лабораторные занятия	0
практические занятия	16
Самостоятельная работа обучающихся (всего)	79,9
Контроль (подготовка к экзамену)	4
Контактная работа по промежуточной аттестации (всего АттКР)	0,1
в том числе:	
зачет	0,1
зачет с оценкой	не предусмотрен
курсовая работа (проект)	не предусмотрена
экзамен (включая консультацию перед экзаменом)	не предусмотрен

4 Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий

4.1 Содержание дисциплины

Таблица 4.1.1 – Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам)

№ п/п	Раздел (тема) дисциплины	Содержание
1	2	3
11	Понятие риска:	Риски в окружающем нас мире. Риск и неопределенность. Объективное и субъективное понимание риска. Структурные характеристики риска. Риск и информация: фантомные риски.
2	Общесистемная классификация рисков Экономические риски как объект исследования: Специфические классификации рисков.	Общесистемная классификация рисков. Классификационные признаки. Специфические классификации рисков. Временные и объектно-территориальные риски. Статические и динамические риски. Временные и объектно-территориальные риски. Статические и динамические риски. Особенности возникновения экономических рисков. Производственные и финансовые риски, как часть экономических рисков: Методологические принципы.

3	Принципы и подходы оценки риска. Качественные и количественные методы оценки рисков: Методы экспертного оценивания. Статистические показатели оценки риска. Анализ чувствительности.	Система принципов оценки риска. Методологические принципы. Методические принципы. Операциональные принципы. Функциональные и структурные подходы к оценке риска. Ресурсный подход к оценке риска. Методы экспертного оценивания: историко- ассоциативный, литературно-фантастическая аналогия, концептуальный перенос. Роза рисков. Оценка риска с помощью экспертного листа. Метод Дельфи. Методика оценки риска Эксперт-РА. Метод SWOT-анализа. Общесистемная классификация количественных методов анализа и оценки рисков. Абсолютные показатели оценки риска. Относительные показатели оценки риска. Вероятностные показатели оценки риска. Статистические показатели оценки риска. Анализ чувствительности. Анализ сценариев развития проекта. Метод проверки устойчивости. Метод Монте-Карло. Дерево решений. Теория игр в риск-менеджменте. Выбор решений в условиях неопределенности. Критерий Лапласа. Критерий Гурвица. Анализ доходности и риска финансовых операций на основе принципа оптимальности Парето. Процесс оценивания рисков на основе ресурсного подхода
4	Концепции управления риском: Компаративный анализ основных концепций управления рисками. Цикл управления риском. Концепция приемлемого риска. Психологические основы управления риском.	Компаративный анализ основных концепций управления рисками. Цикл управления риском. Концепция приемлемого риска. Психологические основы управления риском. Психологические основы управления риском. Интегрированный риск – менеджмент. Специфика управления портфелем рисков. Агрегация рисков
5	Способы снижения степени риска:	Избежание риска. Удержание риска. Диверсификация риска. Распределение риска между участниками проекта. Лимитирование. Страхование. Хеджирование. Резервирование средств на покрытие непредвиденных расходов.

Таблица 4.1.2 – Содержание дисциплины и его методическое обеспечение

№ п/п	Раздел (тема) дисциплины	Виды деятельности			Учебно-методические материалы	Формы текущего контроля успеваемости	Компетенции
		лек., час	№ лаб.	№ пр.			
1	2	3	4	5	6	7	8
1	Понятие риска:	1		1	У-1-5, МУ-1-2	Т	ПК-4.1 ПК- 4.2
2	Общесистемная классификация рисков Экономические риски как объект исследования: Специфические классификации рис-	1		2	У-1-5, МУ-1-2	Т	ПК-4.1 ПК- 4.2

	ков						
3	Принципы и подходы оценки риска. Качественные и количественные методы оценки рисков: Методы экспертного оценивания. Статистические показатели оценки риска. Анализ чувствительности.	4		3	У-1-5, МУ-1-2	3	ПК-4.1 ПК- 4.2
4	Концепции управления риском: Компаративный анализ основных концепций управления рисками. Цикл управления риском. Концепция приемлемого риска. Психологические основы управления риском.	1		4	У-1-5, МУ-1-2	С, Т	ПК-4.1 ПК- 4.2
5	Способы снижения степени риска:	1		5	У-1-5, МУ-1-2	С, Т	ПК-4.1 ПК- 4.2

Т – тестовые задания

4.2 Лабораторные работы и (или) практические занятия

4.2.1 Практические занятия

Таблица 4.2.1 – Практические занятия

№	Наименование практического (семинарского) занятия	Объем, час.
1	Понятие риска	2
2	Общесистемная классификация рисков	2
3	Качественные и количественные методы оценки рисков:	4
4	Концепции управления риском	4
5	Способы снижения степени риска	4
ИТОГО		16

4.3 Самостоятельная работа студентов (СРС)

Таблица 4.3 – Самостоятельная работа студентов

№ раздела (темы)	Наименование раздела (темы) дисциплины	Срок выполнения	Время, затрачиваемое на выполнение СРС, час
1	2	3	4
1.	Понятие риска:	межсессионный период в зависимости от установленных в расписании недель семестра	10
2.	Общесистемная классификация рисков Экономические риски как объект исследования: Специфические классификации рисков	межсессионный период в зависимости от установленных в расписании недель семестра	10
3.	Принципы и подходы оценки риска. Качественные и количественные методы оценки рисков: Методы экспертного оценивания. Статистические показатели оценки риска. Анализ чувствительности.	межсессионный период в зависимости от установленных в расписании недель семестра	20
4.	Концепции управления риском: Компаративный анализ основных концепций управления рисками. Цикл управления риском. Концепция приемлемого риска. Психологические основы управления риском	межсессионный период в зависимости от установленных в расписании недель семестра	20
5	Способы снижения степени риска	межсессионный период в зависимости от установленных в расписании недель семестра	19,9
Итого			79,9

5 Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

Студенты могут при самостоятельном изучении отдельных тем и вопросов дисциплин пользоваться учебно-наглядными пособиями, учебным оборудованием и методическими разработками кафедры в рабочее время, установленное Правилами внутреннего распорядка работников.

Учебно-методическое обеспечение для самостоятельной работы обучающихся по данной дисциплине организуется:

библиотекой университета:

- библиотечный фонд укомплектован учебной, методической, научной, периодической, справочной и художественной литературой в соответствии с УП и данной РПД;
- имеется доступ к основным информационным образовательным ресурсам, информационной базе данных, в том числе библиографической, воз-

возможность выхода в Интернет.

кафедрой:

- путем обеспечения доступности всего необходимого учебно-методического и справочного материала;
- путем предоставления сведений о наличии учебно-методической литературы, современных программных средств.
- путем разработки:
 - методических рекомендаций, пособий по организации самостоятельной работы студентов;
 - тем рефератов;
 - вопросов к зачету;
 - методических указаний к выполнению лабораторных работ и т.д.

типографией университета:

- помощь авторам в подготовке и издании научной, учебной и методической литературы;
- удовлетворение потребности в тиражировании научной, учебной и методической литературы.

6 Образовательные технологии. Технологии использования воспитательного потенциала дисциплины

Реализация компетентностного подхода предусматривает широкое использование в образовательном процессе активных и интерактивных форм проведения занятий в сочетании с внеаудиторной работой с целью формирования универсальных, общепрофессиональных и профессиональных компетенций обучающихся.

Таблица 6.1 – Интерактивные образовательные технологии, используемые при проведении аудиторных занятий

№	Наименование раздела (темы лекции, практического или лабораторного занятия)	Используемые интерактивные образовательные технологии	Объем, час.
1	2	3	4
1	Лекции раздела «Принципы и подходы оценки риска. Качественные и количественные методы оценки рисков: Методы экспертного оценивания. Статистические показатели оценки риска. Анализ чувствительности.».	Разбор конкретных ситуаций	2
2	Практическое занятие по теме Качественные и количественные методы оценки рисков	Разбор конкретных ситуаций	2
3	Практическое занятие по теме Концепции управления риском	Разбор конкретных ситуаций	2
Итого:			6

Содержание дисциплины обладает значительным воспитательным потенциалом, поскольку в нем аккумулирован современный социокультурный опыт человечества. Реализация воспитательного потенциала дисциплины осуществляется в рамках единого образовательного и воспитательного процесса и способствует непрерывному развитию личности каждого обучающегося. Дисциплина вносит значимый вклад в формирование общей культуры обучающихся. Содержание дисциплины способствует духовно-нравственному, экономическому, профессионально-трудовому, воспитанию обучающихся).

Реализация воспитательного потенциала дисциплины подразумевает:

– целенаправленный отбор преподавателем и включение в лекционный материал, материал для практических и (или) лабораторных занятий содержания, демонстрирующего обучающимся образцы настоящего научного подвижничества создателей и представителей данной отрасли науки (производства, экономики, культуры), высокого профессионализма ученых (представителей производства, деятелей культуры), их ответственности за результаты и последствия деятельности для природы, человека и общества; примеры подлинной нравственности людей, причастных к развитию науки, экономики и производства, а также примеры высокой духовной культуры, гуманизма, творческого мышления;

– применение технологий, форм и методов преподавания дисциплины, имеющих высокий воспитательный эффект за счет создания условий для взаимодействия обучающихся с преподавателем, другими обучающимися, представителями работодателей (деловые игры, разбор конкретных ситуаций, решение кейсов, и др.);

– личный пример преподавателя, демонстрацию им в образовательной деятельности и общении с обучающимися за рамками образовательного процесса высокой общей и профессиональной культуры.

Реализация воспитательного потенциала дисциплины на учебных занятиях направлена на поддержание в университете единой развивающей образовательной и воспитательной среды. Реализация воспитательного потенциала дисциплины в ходе самостоятельной работы обучающихся способствует развитию в них целеустремленности, инициативности, креативности, ответственности за результаты своей работы – качеств, необходимых для успешной социализации и профессионального становления.

7 Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

7.1 Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения основной профессиональной образовательной программы

Таблица 7.1 – Этапы формирования компетенций

Код и наименование компетенции	Этапы* формирования компетенций и дисциплины (модули) и практики, при изучении/ прохождении которых формируется данная компетенция		
	начальный	основной	завершающий
1	2	3	4
ПК-4 Способен оценивать экономические и социальные условия, риски осуществления предпринимательской деятельности, уметь проводить анализ рыночных и специфических рисков при решении задач управления организацией, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании	Управление капитальными вложениями Организация предпринимательской деятельности Региональные аспекты управления бизнесом Проекты государственно-частного партнерства в регионе Производственная технологическая (проектно-технологическая) практика Оценка бизнеса и управление стоимостью компании		Производственная преддипломная практика Выполнение и защита выпускной квалификационной работы

7.2 Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

Таблица 7.2 – Показатели и критерии оценивания компетенций, шкала оценивания

Код компетенции/ этап (указывается название этапа из п.7.1)	Показатели оценивания компетенций (индикаторы достижения компетенций, закрепленные за дисциплиной)	Критерии и шкала оценивания компетенций		
		Пороговый уровень («удовлетворительно»)	Продвинутый уровень («хорошо»)	Высокий уровень («отлично»)
1	2	3	4	5
ПК-4 основной,	ПК- 4.1 Оценивает	Знать: - критерии,	Знать: - критерии, применя-	Знать: - критерии, применя-

Код компетенции/ этап (указывается название этапа из п. 7.1)	Показатели оценивания компетенций (индикаторы достижения компетенций, закрепленные за дисциплиной)	Критерии и шкала оценивания компетенций		
		Пороговый уровень («удовлетворительно»)	Продвинутый уровень (хорошо)	Высокий уровень («отлично»)
1	2	3	4	5
завершающий	<p>экономические и социальные условия, риски осуществления предпринимательской деятельности</p> <p>ПК – 4.2 Применяет методы оценки и управления рисками, методы инвестиционного и финансового анализа для принятия управленческих решений в условиях риска</p>	<p>применяемые при идентификации риска</p> <p>- методы идентификации риска</p> <p>-методы и технологии построения портфеля, реестра, карт, диаграмм и других форм визуального отображения рисков</p> <p>Уметь:</p> <p>- проводить количественную статистическую оценку рисков на основе фактических событий базы рисков событий</p> <p>Владеть (или Иметь опыт деятельности):</p> <p>навыками оценки экономические и социальные условия, риски осуществления предпринимательской деятельности</p>	<p>емые при идентификации риска</p> <p>- методы идентификации риска</p> <p>-методы и технологии построения портфеля, реестра, карт, диаграмм и других форм визуального отображения рисков</p> <p>Уметь:</p> <p>-определять контекст процесса оценки риска в соответствии с внутренней и внешней средой функционирования организации, а также особые обстоятельства и ограничения</p> <p>- проводить количественную статистическую оценку рисков на основе фактических событий базы рисков событий</p> <p>Владеть (или Иметь опыт деятельности):</p> <p>навыками оценки экономические и социальные условия, риски осуществления предпринимательской деятельности</p> <p>навыками управления рисками, методы инвестиционного</p>	<p>емые при идентификации риска</p> <p>- методы идентификации риска</p> <p>-методы и технологии построения портфеля, реестра, карт, диаграмм и других форм визуального отображения рисков</p> <p>- принципы и правила выбора метода, техники идентификации риска (достаточность ресурсов, характер и степень неопределенности, сложность метода, техники)</p> <p>- возможности инструментов риск-менеджмента для идентификации рисков организации</p> <p>Уметь:</p> <p>-определять контекст процесса оценки риска в соответствии с внутренней и внешней средой функционирования организации, а также особые обстоятельства и ограничения</p> <p>- проводить количественную статистическую оценку рисков на основе фактических событий базы рисков событий</p> <p>- определять и при-</p>

Код компетенции/ этап (указывается название этапа из п.7.1)	Показатели оценивания компетенций (индикаторы достижения компетенций, закрепленные за дисциплиной)	Критерии и шкала оценивания компетенций		
		Пороговый уровень («удовлетворительно»)	Продвинутый уровень (хорошо)	Высокий уровень («отлично»)
1	2	3	4	5
			и финансового анализа для принятия управленческих решений в условиях риска	<p>менять на практике эффективные методы визуализации рисков организации (в том числе методы построения портфеля, реестра, карты рисков) совместно с ответственными за риск сотрудниками - собственниками риска, оказывать помощь ответственным за риск сотрудникам в правильной идентификации (описании, измерении и оценке) рисков</p> <p><i>Владеть (или Иметь опыт деятельности):</i></p> <p>навыками оценки экономические и социальные условия, риски осуществления предпринимательской деятельности</p> <p>навыками управления рисками, методы инвестиционного и финансового анализа для принятия управленческих решений в условиях риска</p>

7.3 Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения основной профессиональной образовательной программы

Таблица 7.3 - Паспорт комплекта оценочных средств для текущего контроля успеваемости

№ п/п	Раздел (тема) дисциплины	Код контролируемой компетенции (или ее части)	Технология формирования	Оценочные средства		Описание шкал оценивания
				наименование	№№ заданий	
1	2	3	4	5	6	7
1	Понятие риска:	ПК-4.1, ПК-4.2	Лекция, СРС, практическое занятие	Тесты	1-20	Согласно табл.7.2
2	Общесистемная классификация рисков Экономические риски как объект исследования: Специфические классификации рисков	ПК-4.1, ПК-4.2	Лекция, СРС, практическое занятие	Тесты	1-20	Согласно табл.7.2
3	Принципы и подходы оценки риска. Качественные и количественные методы оценки рисков: Методы экспертного оценивания. Статистические показатели оценки риска. Анализ чувствительности.	ПК-4.1, ПК-4.2	Лекция, СРС, практическое занятие	Задачи	1-10	Согласно табл.7.2
4	Концепции управления риском: Компаративный анализ основных кон-	ПК-4.1, ПК-4.2	Лекция, СРС, практическое занятие	Тесты	1-20	Согласно табл.7.2

№ п/п	Раздел (тема) дисциплины	Код контролируемой компетенции (или ее части)	Технология формирования	Оценочные средства		Описание шкал оценивания
				наименование	№№ заданий	
1	2	3	4	5	6	7
	цепей управления рисками. Цикл управления риском. Концепция приемлемого риска. Психологические основы управления риском			Ситуационные задачи	1-3	
5	Способы снижения степени риска	ПК-4.1, ПК-4.2	Лекция, СРС, практическое занятие	Тесты Ситуационные задачи	1-20 1-3	Согласно табл.7.2

Примеры типовых контрольных заданий для проведения текущего контроля успеваемости

Вопрос тестового задания по теме 1

Риск – это:

- 1 неблагоприятное событие, влекущее за собой убыток
- 2 все предпосылки, могущие негативно повлиять на достижение стратегических целей в течение строго определенного временного промежутка
- 3 вероятность наступления стихийных бедствий либо технических аварий
- 4 вероятность провала программы продаж

Пример задачи по теме 3

Рассматриваются два инвестиционных проекта. Пер вый с вероятностью 0,65 обеспечивает доход в 10 млн руб., однако с вероятностью 0,35 убытки могут составить 6 млн. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,7 можно получить доход 8 млн. руб., с вероятностью 0,3 убытки 4 млн. руб. Какой из проектов следует реализовать? Ответ аргументировать.

Типовые задания для проведения промежуточной аттестации обучающихся

Промежуточная аттестация по дисциплине проводится в форме зачета. Зачет проводится в форме тестирования (компьютерного).

Для тестирования используются контрольно-измерительные материалы (КИМ) – вопросы и задания в тестовой форме, составляющие банк тестовых заданий (БТЗ) по дисциплине, утвержденный в установленном в университете порядке.

Проверяемыми на промежуточной аттестации элементами содержания являются темы дисциплины, указанные в разделе 4 настоящей программы. Все темы дисциплины отражены в КИМ в равных долях (%). БТЗ включает в себя не менее 100 заданий и постоянно пополняется. БТЗ хранится на бумажном носителе в составе УММ и электронном виде в ЭИОС университета.

Для проверки *знаний* используются вопросы и задания в различных формах:

- закрытой (с выбором одного или нескольких правильных ответов),
- открытой (необходимо вписать правильный ответ),
- на установление правильной последовательности,
- на установление соответствия.

Умения, навыки (или опыт деятельности) и компетенции проверяются с помощью компетентностно-ориентированных задач (ситуационных, производственных или кейсового характера) и различного вида конструкторов.

Все задачи являются многоходовыми. Некоторые задачи, проверяющие уровень сформированности компетенций, являются многовариантными. Часть умений, навыков и компетенций прямо не отражена в формулировках задач, но они могут быть проявлены обучающимися при их решении.

В каждый вариант КИМ включаются задания по каждому проверяемому элементу содержания во всех перечисленных выше формах и разного уровня сложности. Такой формат КИМ позволяет объективно определить качество освоения обучающимися основных элементов содержания дисциплины и уровень сформированности компетенций.

Примеры типовых заданий для проведения промежуточной аттестации обучающихся

Задание в закрытой форме:

Управление риском – это:

- 1 отказ от рискованного проекта
- 2 комплекс мер, направленных на снижение вероятности реализации риска
- 3 комплекс мер, направленных на компенсацию, снижение, перенесение, принятиериска или уход от него
- 4 комплекс мероприятий, направленных на подготовку к реализации риска

Задание в открытой форме:

Карта рисков - это?

Задание на установление правильной последовательности,

Выявить последовательность действий:

- 1.Выявление расхождений в альтернативах риска
- 2 разработка конкретных мероприятий, направленных на минимизацию или устранение негативных последствий
- 3 учет психологического восприятия рискованных проектов

Задание на установление соответствия:

Соотнесите понятия и их характеристику

Виды логистики	Характеристика
Риск	комплекс мер, направленных на компенсацию, снижение, перенесение, принятия риска или уход от него
Управление риском	парадигма стоимости риска
VAR	все предпосылки, могущие негативно повлиять на достижение стратегических целей в течение строго определенного временного промежутка
Волатильность	изменчивость рыночного спроса

Компетентностно-ориентированная задача:

Компания «Крокус» занимается производством оборудования для химической промышленности. Руководством компании было принято решение расширить ассортимент своей продукции, добавив его техникой с новой технологией. Разработать карту рисков для этого проекта.

Полностью оценочные материалы и оценочные средства для проведения промежуточной аттестации обучающихся представлены в УММ по дисциплине.

7.4 Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций

Процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций, регулируются следующими нормативными актами университета:

- положение П 02.016 «О балльно-рейтинговой системе оценивания результатов обучения по дисциплинам (модулям) и практикам при освоении обучающимися образовательных программ»;

- методические указания, используемые в образовательном процессе, указанные в списке литературы.

Для *текущего контроля успеваемости* по дисциплине в рамках действующей в университете балльно-рейтинговой системы применяется следующий порядок начисления баллов:

Таблица 7.4 – Порядок начисления баллов в рамках БРС

Форма контроля	Минимальный балл		Максимальный балл	
	балл	примечание	балл	примечание
Задания для подготовки отчетов о самостоятельной работе (контрольные задания по изученным темам дисциплины)	0	Не выполнил отчет о самостоятельной работе и задания для СРС	36	Выполнил отчет о самостоятельной работе и задания для СРС, доля правильных ответов более 50 %
Итоговое количество баллов за успеваемость	0		36	
Итоговое количество баллов за посещаемость	0	Не посещал занятий	14	Пропусков занятий не было
Контроль (форма контроля, тестирование)	0		60	

Для промежуточной аттестации обучающихся, проводимой в виде компьютерного тестирования, используется следующая методика оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности. Студент сдаёт тест на компьютере в учебном заведении. В каждом варианте КИМ – 20 (или более / менее) тестовых вопросов (заданий). Максимальное количество баллов за тестирование у очно-заочной формы обучения - 60 баллов.

8 Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

8.1 Основная учебная литература

1.Каранина, Е. В. Управление рисками: механизмы, инструменты, профессиональные стандарты : / Е. В. Каранина. – Москва ; Берлин : Директ-Медиа, 2020. – 257 с. : ил., табл., схем. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=576521> (дата обращения: 21.08.2021). – Библиогр. в кн. – ISBN 978-5-4499-1161-2. – DOI 10.23681/576521. – Текст : электронный.

2.Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент : учебник / А. Н. Фомичев. – 7-е изд. – Москва : Дашков и К°, 2020. – 372 с. : ил. – (Учебные издания для бакалавров). – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=573397> (дата обращения: 21.08.2021). – Библиогр. в кн. – ISBN 978-5-394-03820-4. – Текст : электронный.

8.2 Дополнительная учебная литература

3. Киселев, А. А. Риск-менеджмент в управлении организациями: учебник для бакалавриата : / А. А. Киселев. – Москва ; Берлин : Директ-Медиа, 2019. – 173 с. : ил., схем. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=575459> (дата обращения: 21.08.2021). – Библиогр.: с. 157-158. – ISBN 978-5-4499-0851-3. – Текст : электронный.

4. Марченко, Б. И. Анализ риска: основы управления рисками : / Б. И. Марченко ; Южный федеральный университет. – Ростов-на-Дону ; Таганрог : Южный федеральный университет, 2019. – 123 с. : ил. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=577781> (дата обращения: 21.08.2021). – Библиогр. в кн. – ISBN 978-5-9275-3124-0. – Текст : электронный.

5. Шапкин, А. С. Экономические и финансовые риски: оценка, управление, портфель инвестиций : / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. – 9-е изд. – Москва : Дашков и К°, 2018. – 544 с. : ил. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=496079> (дата обращения: 21.08.2021). – Библиогр.: с. 531-536. – ISBN 978-5-394-02150-3. – Текст : электронный.

8.3 Перечень методических указаний

1. Управление финансовыми и производственными рисками [Электронный ресурс] : методические рекомендации по проведению практических занятий / Юго-Зап. гос. ун-т ; сост. М.Г. Клевцова. - Курск : ЮЗГУ, 2021. - 18 с.

2. Управление финансовыми и производственными рисками [Электронный ресурс] : методические рекомендации для самостоятельной работы / Юго-Зап. гос. ун-т ; сост. М.Г. Клевцова. - Курск : ЮЗГУ, 2021. – 28 с.

8.4 Другие учебно-методические материалы

При изучении дисциплины используются персональные компьютеры, могут быть применены демоверсии программных продуктов. В качестве источника информации используются справочные правовые системы «Консультант-Плюс» и «Гарант

Журналы (периодические издания):

1. Известия ЮЗГУ.
2. Известия ЮЗГУ. Серия: Экономика. Социология. Менеджмент.
3. Вопросы статистики.
4. Вопросы экономики.
5. Инновации.

7. Менеджмент в России и за рубежом.
8. Маркетинг в России и за рубежом.
9. Эксперт РА.
11. Российский экономический журнал.

9 Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины

Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети:

1. Научная библиотека Юго-Западного государственного университета
- <http://www.lib.swsu.ru/2011-02-23-15-22-58/2012-08-30-06-40-55.html>
2. Электронно-библиотечная система «Университетская библиотека онлайн» - <http://biblioclub.ru>
3. Научная электронная библиотека eLibrary.ru (официальный сайт) - <http://elibrary.ru>
4. База данных рефератов и цитирования «Scopus» - <http://www.scopus.com>
5. Электронная библиотека диссертаций и авторефератов РГБ - <http://dvs.rsl.ru/>
6. Официальный сайт Минэкономразвития РФ - www.economy.gov.ru
7. Справочно-поисковая система КонсультантПлюс - www.consultant.ru
8. Электронно-библиотечная система «Лань» - <http://e.lanbook.com/>
9. Образовательный ресурс «Единое окно» - <http://window.edu.ru/>
10. Научно-информационный портал ВINITI РАН - <http://viniti.ru>

10 Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Основными видами аудиторной работы студента при изучении дисциплины «Управление финансовыми и производственными рисками» являются лекции и лабораторные занятия. Студент не имеет права пропускать занятия без уважительных причин.

На лекциях излагаются и разъясняются основные понятия темы, связанные с ней теоретические и практические проблемы, даются рекомендации для самостоятельной работы. В ходе лекции студент должен внимательно слушать и конспектировать материал.

Изучение наиболее важных тем или разделов дисциплины завершают лабораторные занятия, которые обеспечивают контроль подготовленности студента; закрепление учебного материала; приобретение опыта устных публичных выступлений, ведения дискуссии, в том числе аргументации и защиты выдвигаемых положений и тезисов.

Лабораторному занятию предшествует самостоятельная работа студента, связанная с освоением материала, полученного на лекциях, и материалов,

изложенных в учебниках и учебных пособиях, а также литературе, рекомендованной преподавателем.

По согласованию с преподавателем или по его заданию студенты готовят рефераты по отдельным темам дисциплины, выступают на занятиях с докладами. Основу докладов составляет, как правило, содержание подготовленных студентами рефератов.

Качество учебной работы студентов преподаватель оценивает по результатам тестирования, собеседования, защиты отчетов по лабораторным работам, а также по результатам докладов.

Преподаватель уже на первых занятиях объясняет студентам, какие формы обучения следует использовать при самостоятельном изучении дисциплины «Управление финансовыми и производственными рисками»: конспектирование учебной литературы и лекции, составление словарей понятий и терминов и т. п.

В процессе обучения преподаватели используют активные формы работы со студентами: чтение лекций, привлечение студентов к творческому процессу на лекциях, отработку студентами пропущенных лекций, участие в групповых и индивидуальных консультациях (собеседовании). Эти формы способствуют выработке у студентов умения работать с учебником и литературой. Изучение литературы составляет значительную часть самостоятельной работы студента. Это большой труд, требующий усилий и желания студента. В самом начале работы над книгой важно определить цель и направление этой работы. Прочитанное следует закрепить в памяти. Одним из приемов закрепления освоенного материала является конспектирование, без которого немислима серьезная работа над литературой. Систематическое конспектирование помогает научиться правильно, кратко и четко излагать своими словами прочитанный материал.

Самостоятельную работу следует начинать с первых занятий. От занятия к занятию нужно регулярно прочитывать конспект лекций, знакомиться с соответствующими разделами учебника, читать и конспектировать литературу по каждой теме дисциплины. Самостоятельная работа дает студентам возможность равномерно распределить нагрузку, способствует более глубокому и качественному освоению учебного материала. В случае необходимости студенты обращаются за консультацией к преподавателю по вопросам дисциплины «Управление финансовыми и производственными рисками» с целью освоения и закрепления компетенций.

Основная цель самостоятельной работы студента при изучении дисциплины «Управление финансовыми и производственными рисками» - закрепить теоретические знания, полученные в процессе лекционных занятий, а также сформировать практические навыки самостоятельного анализа особенностей дисциплины.

11 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости)

1. MSDN subscriptions: Windows 7, Windows 8, Windows 10 (Договор IT000012385)

2. Microsoft Office

- Office 2007 Suites WG33Y-HW9V4-HYYT6-RKXQC-9G94T
- Office Standard 2010 MAK MM4WT-7XGV2-3DW28-KYQQK-3648H
- Office Std 2013 MAK NBYTG-R4MCC-27CMM-MQCKY-HT7VT
- Office Standard 2016 MAK K69RB-GWNJC-BQMFC-C6F2D-RJRJC

3. Справочно-правовая система «Консультант +» (договор №219894 от 25.12.2017 г.)

4. Свободно распространяемое и бесплатное ПО:

- LibreOffice (<https://ru.libreoffice.org/download/>)
- OpenOffice (<https://ru.libreoffice.org/download/>)

12 Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине

Учебная аудитория для проведения занятий, а также лаборатория (компьютерный класс) кафедры региональной экономики и менеджмента оснащена учебной мебелью: столы и стулья для обучающихся; стол и стул для преподавателя; доска.

При изучении дисциплины используются компьютеры (компьютерный класс – аудитория а-40), проекторы и т.д., в частности:

- Системные блоки учащихся HELIOProviceVL310. клавиат.мышь, предустанов. ПОMicrosoftoffice 2003 Pro Rus;
- Мониторы 15" TFT Proview;
- ПК S1155 Intel i3-2130 3.4 Hz / DDR III-4Gb / HDD SATA III 320 Gb / DVD + R/RW, 23" LCD Samsung;
- Экран Screen Media Apollo 153×203 на штативе;
- Мультимедиацентр: ноутбук ASUS X50VL PMD-T2330/14"/1024Mb/160Gb/сумка / проектор inFocus IN24+ (2 шт.);
- Проектор Vivitek D517;
- Моторизованный экран для формирования отчетной документации и демонстрации итоговых результатов.

В компьютерном классе кафедры региональной экономики и менеджмента обеспечена доступность студентам к сети Интернет.

Вуз обеспечен необходимым комплектом лицензионного программного обеспечения: стандартные программные продукты, Справочно-правовая система «Консультант Плюс». При проведении лекционных занятий с целью лучшего восприятия студентами учебного материала используются нагляд-

ные формы представления информации в виде слайдов. Для этих целей применяется персональный компьютер (ноутбук), мультимедиа проектор, экран.

13 Особенности реализации дисциплины для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья

При обучении лиц с ограниченными возможностями здоровья учитываются их индивидуальные психофизические особенности. Обучение инвалидов осуществляется также в соответствии с индивидуальной программой реабилитации инвалида (при наличии).

Для лиц с нарушением слуха возможно предоставление учебной информации в визуальной форме (краткий конспект лекций; тексты заданий, напечатанные увеличенным шрифтом), на аудиторных занятиях допускается присутствие ассистента, а также сурдопереводчиков и тифлосурдопереводчиков. Текущий контроль успеваемости осуществляется в письменной форме: обучающийся письменно отвечает на вопросы, письменно выполняет практические задания. Доклад (реферат) также может быть представлен в письменной форме, при этом требования к содержанию остаются теми же, а требования к качеству изложения материала (понятность, качество речи, взаимодействие с аудиторией и т. д.) заменяются на соответствующие требования, предъявляемые к письменным работам (качество оформления текста и списка литературы, грамотность, наличие иллюстрационных материалов и т.д.). Промежуточная аттестация для лиц с нарушениями слуха проводится в письменной форме, при этом используются общие критерии оценивания. При необходимости время подготовки к ответу может быть увеличено.

Для лиц с нарушением зрения допускается аудиальное предоставление информации, а также использование на аудиторных занятиях звукозаписывающих устройств (диктофонов и т.д.). Допускается присутствие на занятиях ассистента (помощника), оказывающего обучающимся необходимую техническую помощь. Текущий контроль успеваемости осуществляется в устной форме. При проведении промежуточной аттестации для лиц с нарушением зрения тестирование может быть заменено на устное собеседование по вопросам.

Для лиц с ограниченными возможностями здоровья, имеющих нарушения опорно-двигательного аппарата, на аудиторных занятиях, а также при проведении процедур текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации могут быть предоставлены необходимые технические средства (персональный компьютер, ноутбук или другой гаджет); допускается присутствие ассистента (ассистентов), оказывающего обучающимся необходимую техническую помощь (занять рабочее место, передвигаться по аудитории, прочесть задание, оформить ответ, общаться с преподавателем).

