Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Кислова Наталья Николаевна
Должность: Проректор по УМР и качеству образования
Дата подписания: 29.10.2024 12:07:58
Уникальный программный ключ:
52802513f5b14a975b3e9b13008093d5726b159bf6064f865ae65b96a966c035

МИНИСТЕРСТВО ПРОСВЕЩЕНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования
«Самарский государственный социально-педагогический университет»

Кафедра экономики и экономической безопасности

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по УМР и КО,
председатель УМС СГСПУ

_____ Н.Н. Кислова

Риск-менеджмент системы экономической безопасности предприятия

рабочая программа дисциплины (модуля)

Закреплена за кафедрой **Экономики и экономической безопасности**

Учебный план ФЭУС-м26УЭв(2г6м)
Направление подготовки: 38.04.02 Менеджмент
Направленность (профиль): "Управление экономической безопасностью организации"
Реализуется исключительно с применением ДОТ и (или) ЭО

Квалификация **магистр**

Форма обучения **очно-заочная**

Общая трудоемкость **6 ЗЕТ**

Часов по учебному плану 216
в том числе:
аудиторные занятия 48
самостоятельная работа 168

Виды контроля в семестрах:
экзамены 4

Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр(Курс.Номер семестра на курсе)	**4(2.2)**		Итого	
Вид занятий	УП	РПД	УП	РПД
Лекции	18	18	18	18
Практические	30	30	30	30
В том числе инт.	10	10	10	10
Итого ауд.	48	48	48	48
Контактная работа	48	48	48	48
Сам. работа	168	168	168	168
Итого	216	216	216	216

Программу составил(и):

Сахчинская Наталья Сергеевна

При наличии обучающихся из числа лиц с ограниченными возможностями здоровья, которым необходим особый порядок освоения дисциплины (модуля), по их желанию разрабатывается адаптированная к ограничениям их здоровья рабочая программа дисциплины (модуля).

Рабочая программа дисциплины

Риск-менеджмент системы экономической безопасности предприятия

разработана в соответствии с ФГОС ВО:

Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - магистратура по направлению подготовки 38.04.02 Менеджмент (приказ Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 952)

составлена на основании учебного плана:

Направление подготовки: 38.04.02 Менеджмент
Направленность (профиль): "Управление экономической безопасностью организации"
утвержденного Учёным советом СГСПУ от 25.03.2026 протокол № 8.

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры

Экономики и экономической безопасности

Протокол от 23.06.2026 г. № 11.

И.о. зав. кафедрой Н.С. Сахчинская

Начальник УОП


_____ Н.А. Доманина

1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Цель изучения дисциплины: сформировать заданные ОПОП ВО аспекты компетенций
Задачи изучения дисциплины: сформировать запланированные образовательные результаты.
Область профессиональной деятельности: 08 Финансы и экономика

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Цикл (раздел) ОП: Б1.В.ДВ.01

2.1 Требования к предварительной подготовке обучающегося:

Содержание дисциплины базируется на материале:

Финансовый анализ в системе экономической безопасности организации

2.2 Дисциплины (модули) и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:

Производственная практика (преддипломная практика)

3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

ПК-2. Осуществляет разработку и реализацию риск-ориентированного подхода к управлению в организациях

ПК-2.1 Проектирует структуру интегральной системы управления риск-менеджментом в системе экономической безопасности предприятия

Знает: основные виды рисков, методы их оценки в системе экономической безопасности предприятия
Умеет: применять количественные и качественные подходы к управлению риск-менеджментом организации

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Код занятия	Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр	Часов	Интеракт.
	Раздел 1. Риск-менеджмент системы экономической безопасности предприятия			
1.1	Риск-менеджмент /Лек/	4	8	4
1.2	Риск-менеджмент /Пр/	4	14	6
1.3	Риск-менеджмент /Ср/	4	84	0
1.4	Методы управления рисками, мониторинг рисков /Лек/	4	10	0
1.5	Методы управления рисками, мониторинг рисков /Пр/	4	16	0
1.6	Методы управления рисками, мониторинг рисков /Ср/	4	84	0

5. Оценочные и методические материалы по дисциплине (модулю)

5.1. Содержание аудиторной работы по дисциплине (модулю)

4 семестр, 9 лекций, 15 практических занятий

Раздел 1. Риск-менеджмент системы экономической безопасности предприятия

Лекции № 1-4 (8 часов)

Риск-менеджмент

Вопросы и задания:

1. Определение понятия риск. История риск менеджмента. Задачи риск-менеджмента. Коэффициент риска.
2. Функции объекта управления (разрешения риска; рисковых вложений капитала; работы по снижению величины риска; процесса страхования рисков; экономических отношений и связей между субъектами хозяйственного процесса) и функции субъекта управления (прогнозирование; организация; регулирование; координация; стимулирование; контроль).
3. Процесс организации риск-менеджмента: выработка цели риска и рисковых вложений капитала, определение вероятности наступления события, выявление степени и величины риска, анализ окружающей обстановки, выбор стратегии управления риском, выбор необходимых для данной стратегии приемов управления риском и способов его снижения (т.е. приемов риск-менеджмента), осуществление целенаправленного воздействия на риск
4. Основные правила риск-менеджмента. Информационное обеспечение функционирования риск-менеджмента.

Практические занятия № 1-7 (14 часов)

Риск-менеджмент

Вопросы и задания:

Решение задач

Лекции № 5-9 (10 часов)

Методы управления рисками, мониторинг рисков

Вопросы и задания:

1. Источники информации для идентификации рисков. Методы выявления рисков и практика их применения. Опросные листы. Потоковые диаграммы. Инспекции. Анализ отчетности и документации, организационной и функциональной структуры предприятия. Комбинации различных методов выявления.
2. Классификация рисков по субъективно-объективным характеристикам. Классификация рисков по условиям возникновения. Классификация рисков по содержанию. Классификация рисков по возможным последствиям. Классификация рисков по возможности передачи и снижения. Валютный и инвестиционный финансовые риски. Производственный риск.

3. Классификация методов управления рисками. Методы локализации и диссипации риска, компенсации, снижения, финансирования рисков. Страхование или хеджирование.
4. Построение системы мониторинга и контроля системы риск-менеджмента. Основные виды мониторинга и контроля. Анализ ресурсов и возможностей при построении системы мониторинга и контроля. Оценка эффективности системы риск-менеджмента и ее критерии
5. Преимущества и недостатки страхования. Программа страхования организации. Анализ экономической эффективности страхования и самострахования.
6. Качественные и количественные методы оценки рисков. Оценка риска по косвенным показателям. Доходность как мера риска. Оценка риска по косвенным показателям. Метод дюрации. Оценка риска по чувствительности. Оценка риска по волатильности. Коэффициент сигма VAR-оценка риска. Методы оценки индексов опасности.
7. Анализ риска инвестиций. Понятие инвестиционного портфеля. Виды портфельных стратегий.

Практические занятия № 8-15 (16 часов)

Методы управления рисками, мониторинг рисков

Вопросы и задания:
Решение задач

5.2. Содержание самостоятельной работы по дисциплине (модулю)

Содержание обязательной самостоятельной работы по дисциплине

№ п/п	Темы дисциплины	Содержание самостоятельной работы	Продукты деятельности
1	Риск-менеджмент	Выполнение письменных домашних заданий, получаемых на занятии (образцы заданий представлены в БРК)	Письменная работа
2	Методы управления рисками, мониторинг рисков		

Содержание самостоятельной работы по дисциплине на выбор

№ п/п	Темы дисциплины	Содержание самостоятельной работы	Продукты деятельности
1	Риск-менеджмент	Выполнение письменных домашних заданий, получаемых на занятии (образцы заданий представлены в БРК)	Письменная работа
2	Методы управления рисками, мониторинг рисков		

5.3.Образовательные технологии

При организации изучения дисциплины будут использованы следующие образовательные технологии: информационно-коммуникационные технологии, технология организации самостоятельной работы, технология рефлексивного обучения, технология модульного обучения, технология игрового обучения, технологии групповой дискуссии, интерактивные технологии, технология проблемного обучения, технология организации учебно-исследовательской деятельности, технология проектного обучения, технология развития критического мышления.

5.4. Текущий контроль, промежуточный контроль и промежуточная аттестация

Балльно-рейтинговая карта дисциплины оформлена как приложение к рабочей программе дисциплины.
Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине оформлен отдельным документом.

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ

Дата обращения к электронным учебным изданиям, электронным образовательным ресурсам, современным базам данных и информационным справочным системам совпадает с датой утверждения рабочей программы

6.1. Рекомендуемая литература

6.1.1. Основная литература

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л1.1	Земсков, В.В.	Внутренний контроль и аудит в системе экономической безопасности хозяйствующего субъекта: учебное пособие для студентов, обучающихся по направлению подготовки 38.04.01 «Экономика», магистерская программа «Финансовые расследования в организациях» : [16+] / В.В. Земсков ; Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации. – Москва : Прометей, 2019. – 159 с. : ил. URL: https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=576140	Москва : Прометей, 2019
Л1.2	К. Е. Турбина, В. В. Барабанова, Л. И. Цветкова, С. Н. Асабина	Современный риск-менеджмент и возможности страхования. Современные концепции оценки и управления рисками : учебное пособие / К. Е. Турбина, В. В. Барабанова, Л. И. Цветкова, С. Н. Асабина ; под общ. ред. К. Е. Турбиной ; Московский государственный институт международных отношений (университет) МИД России, Кафедра управления рисками и страхования. – Москва : МГИМО-Университет, 2023. – 149 с. : табл., граф., рис. – Режим доступа: по подписке. – URL: https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=730640	Москва : МГИМО-Университет, 2023

6.1.2. Дополнительная литература

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Латышева, Л. А.	Латышева, Л. А. Финансовый риск-менеджмент : учебник :	Ставрополь : Ставропольский

		[16+] / Л. А. Латышева, Ю. М. Склярова, И. Ю. Скляров ; под общ. ред. Л. А. Латышевой ; Ставропольский государственный аграрный университет. – Ставрополь : Ставропольский государственный аграрный университет (СтГАУ), 2021. – 377 с. : ил., табл. – Режим доступа: по подписке. – URL: https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=700776	государственный аграрный университет (СтГАУ), 2021

6.2 Перечень программного обеспечения

- Acrobat reader DC
- Dr.Web Desktop security, Dr.Web Server security
- GIMP
- Мой офис, сервисы Яндекс 360 для образования (почта, Яндекс Диск, Яндекс Телемост, Яндекс документы, Календарь)
- Многофункциональный сервис обмена информацией Max
- Архиватор 7-Zip
- Браузер Яндекс для организаций

6.3 Перечень информационных справочных систем, профессиональных баз данных

- ЭБС «Университетская библиотека онлайн»
- Базы данных Springer eBooks

7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

7.1	Наименование специального помещения: учебная аудитория для проведения практических и лекционных занятий, групповых консультаций, индивидуальных консультаций, текущего контроля, курсового проектирования, промежуточной аттестации в формате веб-конференций. Оснащенность: Меловая доска-1шт., Комплект учебной мебели, ноутбук (с выходом в Интернет), проекционное оборудование (мультимедийный проектор и экран).
7.2	Наименование специального помещения: помещение для самостоятельной работы, Читальный зал. Оснащенность: ПК-4шт. с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду СГСПУ, Письменный стол-4 шт., Парта-2 шт.

8. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Работа над теоретическим материалом происходит кратко, схематично, последовательно фиксировать основные положения, выводы, формулировки, обобщения; помечать важные мысли, выделять ключевые слова, термины. Проверка терминов, понятий с помощью энциклопедий, словарей, справочников с выписыванием толкований в тетрадь. Обозначить вопросы, термины, материал, который вызывает трудности, пометить и попытаться найти ответ в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удается разобраться в материале, необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю.

Проработка рабочей программы дисциплины, уделяя особое внимание целям и задачам, структуре и содержанию дисциплины. Конспектирование источников, подготовка ответов к контрольным вопросам, просмотр рекомендуемой литературы, работа с информационными источниками в разных форматах.

Также в процессе изучения дисциплины методические рекомендации могут быть изданы отдельным документом.

Приложение

Балльно-рейтинговая карта дисциплины «Риск-менеджмент системы экономической безопасности предприятия»

Курс 2 Семестр 4

Вид контроля		Минимальное количество баллов	Максимальное количество баллов
Наименование раздела: «Риск-менеджмент системы экономической безопасности предприятия»		-	
Текущий контроль по разделу:		-	
1	Аудиторная работа	-	
2	Самостоятельная работа (специальные обязательные формы)	28	40
3	Самостоятельная работа (специальные формы на выбор)	16	30
Контрольное мероприятие по разделу		12	30
Промежуточный контроль		-	-
Промежуточная аттестация		-	-
Итого:		**56**	**100**

<table>
<tr><th colspan="2">Виды контроля</th><th>Перечень или примеры заданий, критерии оценки и количество баллов</th><th>Темы для изучения и образовательные результаты</th></tr>
<tr><td colspan="4">Текущий контроль по разделу «Риск-менеджмент системы экономической безопасности предприятия»</td></tr>
<tr><td>1</td><td>Аудиторная работа</td><td></td><td>Тема 1. Риск-менеджмент
Тема 2. Методы управления рисками, мониторинг рисков</td></tr>
<tr><td>2</td><td>Самостоятельная работа (обязательные формы)</td><td>Пример задания:
Напишите развернутый ответ на тему: «Бизнес процессы в риск-менеджменте и их интеграция с бизнес процессами компании».
Критерии оценки.
Письменная работа выполняется на стандартном листе формата А4 от руки, максимальный объем работы 2 стр.
<table>
<tr><td>Критерий / Оценка</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>Раскрыта терминология из данного вопроса (не менее 4-х терминов)</td><td>4 термина - 2 балла</td><td>1-3 термина - 1 балл</td><td>0 терминов - 0 баллов</td></tr>
<tr><td>Приведена классификация (или структура)</td><td>Да - 2 балла</td><td></td><td>Нет - 0 баллов</td></tr>
<tr><td>Элементы классификации (структуры) снабжены адекватными комментариями</td><td>Прокомментированы все элементы - 2 балла</td><td>Прокомментированы не все элементы 1 балл</td><td>Комментарии отсутствуют 0 баллов</td></tr>
<tr><td>Элементы классификации</td><td>Проиллюстрированы примерами 2 и более</td><td>Проиллюстрирован примерами 1</td><td>Примеры отсутствуют</td></tr>
</table></td><td>Тема 1. Риск-менеджмент
Тема 2. Методы управления рисками, мониторинг рисков

Образовательные результаты:
Знает: основные виды рисков, методы их оценки в системе экономической безопасности предприятия
Умеет: применять количественные и качественные подходы к управлению риск-менеджментом организации</td></tr>
</table>

		(структуры) проиллюстрированы примерами из хозяйственной практики	элементов 2 балла	элемент 1 балл	0 баллов	
3	Самостоятельная работа (на выбор)	**Пример задания:** **Напишите ответы на вопросы:** 1. Риск аварии грузового судна во время перевозки груза, ожидаемого компанией. 2. Риск слишком резкого снижения курса USD для компании, осуществляющей экспортные операции. 3. Риск возникновения сбоев в поставках сырья. 4. Риск снижения спроса на продукцию предприятия. **Критерии оценки.** 1. Описана актуальность, степень разработанность темы (6 балл); 2. Проведен анализ литературы (1 балл); 3. Даны развернутые выводы (10 балл)				Тема 1. Риск-менеджмент Тема 2. Методы управления рисками, мониторинг рисков Образовательные результаты: Знает: основные виды рисков, методы их оценки в системе экономической безопасности предприятия Умеет: применять количественные и качественные подходы к управлению риск-менеджментом организации
Контрольное мероприятие по разделу		**Пример задания:** Опишите представленные ниже риски предприятия структурно по следующим характеристикам: опасность, подверженность риску, уязвимость (чувствительность к риску) и степень взаимодействия рисков. • Риск невыполнения обязательств со стороны дебиторов (риск неплатежа) • Риск поломки оборудования • Риск нереализации произведенной продукции • Риск неполучения (недополучения) исходного сырья **Критерии оценки.** 1. Описана актуальность, степень разработанность темы (6 балл); 2. Проведен анализ литературы (1 балл); 3. Даны развернутые выводы (10 балл)				Образовательные результаты: Знает: основные виды рисков, методы их оценки в системе экономической безопасности предприятия Умеет: применять количественные и качественные подходы к управлению риск-менеджментом организации
Промежуточный контроль (количество баллов)		-				-
Промежуточная аттестация		Представлены в фонде оценочных средств для промежуточной аттестации по дисциплине				