

**Федеральное государственное бюджетное образовательное
учреждение высшего образования
«РОССИЙСКАЯ АКАДЕМИЯ НАРОДНОГО ХОЗЯЙСТВА
И ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ
ПРИ ПРЕЗИДЕНТЕ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»**

Факультет «Высшая школа корпоративного управления»

(наименование факультета)

Кафедра Управление фирмой

(наименование кафедры)

УТВЕРЖДЕНА
решением кафедры
Протокол от «10» мая 2017 г.
№ 9

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.ДВ.1.3 «Управление рисками»

(индекс, наименование дисциплины в соответствии с учебным планом)

38.04.02 Менеджмент

(код, наименование направления подготовки)

«Управление развитием бизнеса (организации)»

(профиль)

Магистр

(квалификация)

Очная

(формы обучения)

Год набора - 2016

Москва, 2017 г.

Автор–составитель:

К.э.н., начальник финансового отдела

ОАО "Глобалинформсервис" Е.Н. Пузов

Заведующий кафедрой Управление фирмой:

академик РАН, д.э.н., профессор Э.Н. Крылатых

СОДЕРЖАНИЕ

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы
2. Объем и место дисциплины в структуре образовательной программы
3. Содержание и структура дисциплины
4. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся и фонд оценочных средств промежуточной аттестации по дисциплине
5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины
6. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающихся по дисциплине
7. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения программы

1.1. Дисциплина Б1.В.ДВ.1.3 «Управление рисками» обеспечивает овладение следующими компетенциями с учетом этапа:

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
ПК-1	способностью управлять организациями, подразделениями, группами (командами) сотрудников, проектами и сетями	ПК-1.2	способность управлять группами (командами) сотрудников, подразделениями, организациями в профессиональной деятельности
ПК-3	способностью использовать современные методы управления корпоративными финансами для решения стратегических задач	ПК-3.1	способность использовать современные методы управления корпоративными финансами в процессе разработки бизнес плана в профессиональной деятельности

1.2. В результате освоения дисциплины Б1.В.ДВ.1.3 «Управление рисками» у студентов должны быть сформированы:

ОТФ/ТФ (при наличии профстандарта)/ трудовые или профессиональные действия	Код этапа освоения компетенции	Результаты обучения
Профессиональный стандарт Специалист по управлению рисками утв. 07.09.2015 № 591 В/01.7 Планирование деятельности подразделения в соответствии со стратегическими целями организации	ПК-1.2	На уровне знаний: Принципы целеполагания, основы организационного планирования и прогнозирования Национальные и международные документы, стандарты, лучшие практики по построению систем управления рисками Законодательство Российской Федерации и отраслевые стандарты по управлению рисками Корпоративные нормативные акты по управлению рисками в организации Отраслевые стандарты по управлению рисками Внутренний и внешний контекст

		<p> функционирования организации Основы теории управления изменениями Принципы построения систем управления рисками Компоненты системы управления рисками и их взаимосвязь Полномочия и обязательства менеджмента по реализации плана управления рисками Этапы разработки систем управления рисками </p> <p> На уровне умений: Владеть навыками внедрения системы управления рисками Анализировать изменения корпоративной нормативной базы по вопросам управления рисками Выявлять внешний и внутренний контекст функционирования организации Разрабатывать регламентирующие документы по управлению рисками Понимать и правильно применять термины и принципы риск-менеджмента Описывать бизнес-процессы Вырабатывать рекомендации по принятию решений в рамках подразделения Владеть программным обеспечением (текстовые, графические, табличные и аналитические приложения, приложения для визуального представления данных) для работы с информацией на уровне продвинутого пользователя Ставить цели и формулировать задачи, связанные с реализацией профессиональных функций работников Анализировать и координировать объем работ каждого сотрудника в подразделении Составлять календарный план работ работников Оценивать ресурсы, необходимые для эффективного функционирования подразделения Прогнозировать и определять потребность в работниках Формулировать требования к сотрудникам и формировать заявки на подбор Формировать индивидуальный план развития работников Устанавливать и поддерживать деловые контакты, связи, отношения, коммуникации с сотрудниками организации и заинтересованными </p>
--	--	--

		<p>сторонами по вопросам управления рисками</p> <p>На уровне навыков:</p> <p>Определение целей и задач подразделения в соответствии со стратегическими целями организации (декомпозиция стратегических целей организации в задачи подразделения), в соответствии с корпоративными нормативными документами по управлению рисками и требованиями вышестоящего руководства</p> <p>Участие в подборе работников</p> <p>Разработка регламентов деятельности подразделения по управлению рисками и отдельных работников</p> <p>Формирование оперативного и тактического плана работ подразделения</p> <p>Определение требований, задач и планирование деятельности сотрудников подразделения</p> <p>Реализация плана построения системы управления рисками</p> <p>Определение функций, обязанностей и системы подотчетности внутри подразделения</p> <p>Распределение полномочий, ответственности и задач между работниками подразделения</p> <p>Координация деятельности работников подразделения</p> <p>Организация обеспечения работников подразделения по управлению рисками необходимым оборудованием, материально-техническими средствами и доступом к информационным системам организации</p>
<p>Профессиональный стандарт Специалист по управлению рисками утв. 07.09.2015 № 591</p> <p>В/02.7</p> <p>Поддержание эффективных коммуникаций и мотивация работников подразделения</p>	ПК-1.2	<p>На уровне знаний;</p> <p>Основы теории и концепции взаимодействия людей в подразделении, вопросы управления человеческим капиталом, мотивация, групповая динамика, командообразование, коммуникации и управление конфликтами</p> <p>Методы и технологии обмена профессиональным опытом внутри подразделения</p> <p>Принципы, методы и технологии обучения</p> <p>Принципы, методы, технологии и инструменты оценки знаний, умений и личностных качеств работников</p> <p>Принципы и методы создания мотивационных схем и кадрового резерва</p>

		<p>Принципы, методы, технологии и инструменты оценки потребностей в развитии и обучении работников</p> <p>Корпоративные нормативные акты, определяющие нормы профессиональной этики, нормы корпоративного управления и корпоративной культуры</p> <p>Основные методы подбора и управления работниками в организации</p> <p>На уровне умений:</p> <p>Организовывать взаимный обмен профессиональным опытом работников подразделения в целях повышения профессионального уровня</p> <p>Определять и доводить до сведения работников правила взаимодействия в подразделении</p> <p>Находить компромиссные решения</p> <p>Оценивать реальные и потенциальные возможности работников подразделения</p> <p>Применять корпоративные документы и процедуры</p> <p>Анализировать коммуникационные процессы в подразделении и разрабатывать предложения по повышению их эффективности</p> <p>Владеть методами аудита, оценки и аттестации работников</p> <p>Определять ключевые показатели эффективности деятельности работников подразделения</p> <p>Разрабатывать мероприятия по мотивированию и стимулированию работников</p> <p>Разрабатывать программы обучения работников подразделения</p> <p>Владеть методами поддержания позитивного социально-психологического климата в подразделении</p> <p>На уровне навыков:</p> <p>Обсуждение проблем работы подразделения путем проведения регулярных собраний внутри подразделения</p> <p>Предупреждение и разрешение конфликтных ситуаций в подразделении</p> <p>Оповещение работников о предстоящих изменениях</p> <p>Поддержание постоянного и своевременного обмена информацией о рисках</p> <p>Определение потребности в развитии и обучении работников</p> <p>Организация повышения квалификации работников подразделения по вопросам</p>
--	--	--

		<p>деятельности подразделения</p> <p>Составление и анализ мотивационных профилей работников подразделения и формирование кадрового резерва</p>
<p>Профессиональный стандарт Специалист по управлению рисками утв. 07.09.2015 № 591</p> <p>В/03.7</p> <p>Контроль эффективности работы сотрудников и подразделения</p>	ПК-1.2	<p>На уровне знаний:</p> <p>Методы и процедуры контроля деятельности работников и подразделения</p> <p>Методы, технологии, инструменты совершенствования контроля деятельности работников и подразделения</p> <p>Должностные инструкции работников подразделения</p> <p>План работ подразделения и план работ работников подразделения</p> <p>На уровне умений:</p> <p>Формулировать требования к специалистам по управлению рисками</p> <p>Владеть методами аудита, оценки и аттестации работников</p> <p>Формулировать цели и задачи работы подразделения и работников</p> <p>Оценивать деятельность подчиненных работников</p> <p>Формировать решения в рамках подразделения</p> <p>Оценивать результаты работы работников в рамках поставленных задач</p> <p>Оценивать результаты деятельности подразделения и исполнение планов работ подразделения</p> <p>На уровне навыков:</p> <p>Определение процедуры контроля деятельности работников и подразделения</p> <p>Организация процесса предоставления периодических отчетов о выполненных работах от работников подразделения</p> <p>Контроль выполнения работ и функций работниками подразделения</p> <p>Контроль выполнения оперативного и тактического плана работ подразделения</p> <p>Контроль соблюдения работниками корпоративных правил и норм работы в организации</p> <p>Подготовка предложений по существенным изменениям деятельности подразделения</p> <p>Разработка и реализация мер по изменению процедур контроля деятельности работников и подразделения для повышения эффективности работы работников и подразделения</p> <p>Внесение предложений о поощрении либо о наложении дисциплинарного взыскания на</p>

		<p>работников подразделения по результатам контроля эффективности их деятельности</p> <p>Поддержание и совершенствование системы контроля деятельности работников и подразделения</p>
<p>Профессиональный стандарт Специалист по управлению рисками утв. 07.09.2015 № 591</p> <p>В/04.7</p> <p>Разработка системы управления рисками</p>	ПК-1.2	<p>На уровне знаний:</p> <p>Национальные и международные акты, стандарты, лучшие практики по построению систем управления рисками</p> <p>Законодательство Российской Федерации и отраслевые стандарты по управлению рисками</p> <p>Принципы построения систем управления рисками</p> <p>Элементы системы управления рисками и их взаимосвязь</p> <p>Полномочия и обязательства менеджмента по реализации плана управления рисками</p> <p>Этапы разработки систем управления рисками</p> <p>Корпоративные нормативные акты организации по управлению рисками</p> <p>На уровне умений:</p> <p>Адаптировать элементы системы риск-менеджмента к условиям функционирования организации, а также новым бизнес-процессам и направлениям</p> <p>Анализировать и применять методики оценки управления рисками и реагирования на риски</p> <p>Организовывать процесс управления рисками в организации с учетом отраслевых стандартов</p> <p>Обрабатывать информацию по рискам в отрасли и в организации</p> <p>Производить диагностику существующей в организации практики управления рисками</p> <p>Разрабатывать программы по совершенствованию процедур управления рисками в соответствии с лучшими практиками</p> <p>Владеть программным обеспечением (текстовые, графические, табличные и аналитические приложения, приложения для визуального представления данных) для работы с информацией на уровне продвинутого пользователя</p> <p>На уровне навыков:</p> <p>Построение модели корпоративной системы управления рисками, включающей общую конфигурацию системы,</p>

		<p>общую схему управления рисками, принципы организационно-функциональной структуры и информационного обмена</p> <p>Разработка и внедрение рекомендаций по построению структуры системы управления рисками с учетом международных стандартов корпоративного управления и специфики ведения бизнеса организации</p> <p>Разработка требований к программному обеспечению по управлению рисками, помощь в выборе автоматизированной системы управления рисками</p> <p>Создание единой методологии построения системы управления рисками (политики, стандарты, регламенты, план внедрения системы управления рисками)</p>
<p>Профессиональный стандарт Специалист по управлению рисками утв. 07.09.2015 № 591</p> <p>В/05.7</p> <p>Внедрение системы управления рисками</p>	ПК-1.2	<p>На уровне знаний:</p> <p>Принципы внедрения системы управления рисками</p> <p>Принципы внедрения процесса управления рисками</p> <p>Внешний и внутренний контекст процесса управления рисками</p> <p>Национальные и международные акты, стандарты, лучшие практики по построению систем управления рисками</p> <p>Законодательство Российской Федерации и отраслевые стандарты по управлению рисками</p> <p>Принципы управления в чрезвычайных и кризисных ситуациях, а также управление непрерывностью бизнеса</p> <p>Методы оценки и управления рисками и возможности их применения в организации</p> <p>Современные информационные системы и технологии управления рисками и возможности их применения в организации</p> <p>Корпоративные нормативные акты по управлению рисками</p> <p>Корпоративные нормативные акты, определяющие нормы корпоративного управления и корпоративной культуры</p> <p>На уровне умений:</p> <p>Организовывать процесс управления рисками в организации с учетом</p>

		<p>отраслевых стандартов</p> <p>Интегрировать процесс управления рисками в существующую систему управления</p> <p>Обеспечивать взаимодействие между процессом риск-менеджмента и другими процессами в организации</p> <p>Понимать и применять принципы управления рисками в чрезвычайных и кризисных ситуациях</p> <p>Документировать элементы и процесс риск-менеджмента в организации</p> <p>Идентифицировать пути развития чрезвычайных и кризисных ситуаций и их последствия</p> <p>Развивать приемы управления непрерывностью бизнеса</p> <p>Владеть программным обеспечением (текстовые, графические, табличные и аналитические приложения, приложения для визуального представления данных) для работы с информацией на уровне продвинутого пользователя</p> <p>На уровне навыков:</p> <p>Организация процесса внедрения стандартов, политик, процедур и методов управления рисками</p> <p>Организация процесса оценки и мониторинга рисков</p> <p>Организация процесса разработки плана мероприятий по управлению рисками и его утверждение</p> <p>Интеграция управления в чрезвычайных и кризисных ситуациях и управления непрерывностью бизнеса в качестве составляющей процесса управления рисками</p> <p>Постановка задач и контроль внедрения информационной системы управления рисками</p>
<p>Профессиональный стандарт Специалист по управлению рисками утв. 07.09.2015 № 591</p> <p>В/06.7</p> <p>Эксплуатация системы управления рисками</p>	ПК-1.2	<p>На уровне знаний:</p> <p>Внешний и внутренний контекст процесса управления рисками</p> <p>Методы идентификации, оценки и управления рисками и возможности их применения</p> <p>Методики и лучшие практики определения ключевых индикаторов риска</p> <p>Методики, лучшие практики, оценки предельно допустимого уровня риска, исследования предельно допустимого уровня</p>

		<p> риска Процесс управления в чрезвычайных и кризисных ситуациях, а также управление непрерывностью бизнеса Законодательство Российской Федерации и отраслевые стандарты по управлению рисками Национальные и международные акты, стандарты, лучшие практики по построению систем управления рисками Стратегии, методы управления рисками и варианты их применения Принципы построения карты рисков, ее назначение и анализ Корпоративные нормативные акты по управлению рисками в организации Оценка эффективности воздействия на риск: выбор варианта или метода воздействия на риск, подготовка и внедрение планов воздействия на риск Современные информационные системы и технологии управления рисками и возможности их применения </p> <p> На уровне умений: Определять перечень мероприятий, достаточных для покрытия риска Анализировать и применять методики оценки и управления рисками Анализировать отчетность по всем видам рисков организации Производить периодический мониторинг предельно допустимого уровня риска Информировать вышестоящее руководство о существенных фактах по рискам организации Составлять мероприятия и контрольные процедуры по управлению рисками Осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики Выявлять недостатки существующей системы и разрабатывать рекомендации по улучшению процедур управления рисками в соответствии с национальными или международными стандартами Владеть программным обеспечением (текстовые, графические, табличные </p>
--	--	--

		<p>и аналитические приложения, приложения для визуального представления данных) для работы с информацией на уровне продвинутого пользователя, работать со специализированными программами по управлению рисками</p> <p>На уровне навыков: Идентификация, анализ и оценка наиболее критичных рисков организации Подготовка и внедрение планов управления наиболее критичными рисками совместно с ответственными за мероприятия по рискам работниками Оценка предельно допустимого уровня риска организации Мониторинг изменений карты рисков Проведение оценки эффективности воздействия на риск Наблюдение и мониторинг наиболее критичных рисков, их динамики и динамики ключевых индикаторов риска Идентификация и анализ основных сценариев управления в чрезвычайных и кризисных ситуациях, а также управление непрерывностью бизнеса Анализ функционирования системы управления рисками Выработка рекомендаций по дальнейшему развитию системы управления рисками</p>
<p>Профессиональный стандарт Специалист по управлению рисками утв. 07.09.2015 № 591</p> <p>В/07.7 Поддержание устойчивого функционирования системы управления рисками</p>	ПК-1.2	<p>На уровне знаний: Информационная политика организации Требования к коммерческой тайне Нормы этики организации Нормы профессиональной этики Нормы корпоративного управления и корпоративной культуры</p> <p>На уровне умений: Консолидировать и выбирать информацию по интересующим вопросам Объяснять и доносить до работников проблемы по вопросам управления рисками в организации и их решения Преодолевать ошибки группового мышления и предубеждения</p> <p>На уровне навыков: Консультации участников процесса управления</p>

		<p>рисками внутри организации</p> <p>Предоставление необходимой информации по запросам участников процесса управления рисками</p> <p>Коммуникации и консультации с заинтересованными сторонами на всех стадиях процесса управления рисками</p>
<p>Профессиональный стандарт «Специалист по финансовому консультированию» утв. 19.03.2015 № 167н</p> <p>В/02.7</p> <p>Разработка финансового плана для клиента и целевого инвестиционного портфеля</p>	ПК-3.1	<p>На уровне знаний:</p> <p>Принципы формирования стоимости денег во времени</p> <p>Принципы дисконтирования денежного потока</p> <p>Принципы начисления сложных процентов</p> <p>Принципы расчета приведенной и будущей стоимости</p> <p>Принципы расчета доходности активов</p> <p>Методы дисконтирования денежных потоков, методы многовариантности расчетов, методы математического моделирования и количественной оптимизации</p> <p>Отечественные и международные стандарты в области финансового планирования</p> <p>Методика финансового анализа состояния клиента</p> <p>Принципы портфельного управления инвестированием</p> <p>Принципы подбора и распределения активов</p> <p>Принципы соотношения риска и доходности</p> <p>Понятия безрискового актива</p> <p>Способы управления финансовыми рисками</p> <p>На уровне умений:</p> <p>Получать, интерпретировать и документировать результаты исследований</p> <p>Использовать расчетные таблицы и калькуляторы</p> <p>Оценивать затраты на проведение финансовых операций</p> <p>Рассчитывать величину портфеля, достаточную для покрытия финансовых целей</p> <p>Выявлять соответствие/несоответствие инвестиционного профиля клиента параметрам инвестиционного портфеля</p> <p>На уровне навыков:</p> <p>Составление перечня рекомендаций по управлению инвестиционным риском</p>

		Составление инвестиционного портфеля Выявление качественных и количественных свойств рисков в предполагаемых к использованию финансовых продуктах
--	--	---

2. Объем и место дисциплины в структуре ОП ВО

Общая трудоемкость дисциплины Б1.В.ДВ.1.3 «Управление рисками» по учебному плану составляет 2 зачетных единицы; 72 академических часа, 2-й семестр. Количество академических часов, выделенных на контактную работу с преподавателем – 18, в том числе лекции – 6 академических часов, практические занятия – 12 академических часов; на самостоятельную работу обучающихся – 54 академических часа.

Дисциплина Б1.В.ДВ.1.3 «Управление рисками» является одной из дисциплин по выбору в подготовке менеджеров, входит в дисциплины вариативной части.

Глубокое усвоение материала обеспечивается сочетанием аудиторных занятий и самостоятельной работы обучающихся с литературой и нормативными документами. Основным видом учебных занятий по данной дисциплине являются лекции. Практические занятия проводятся в виде дискуссий, семинаров, группового проектного обучения. Изучение дисциплины осуществляется в течение одного семестра: для обучающихся очной формы обучения – в 2-м семестре. По дисциплине осуществляется текущий контроль и промежуточный контроль в форме зачета.

Успешная реализация цели и задач дисциплины Б1.В.ДВ.1.3 «Управление рисками» достигается посредством получения обучающимися знаний, умений и навыков при изучении дисциплин базовой части Б1.Б.1 «Общий менеджмент» (1-й семестр), Б1.Б.2 «Методы исследования в менеджменте» (1-й семестр), Б1.Б.4 «Экономика и управление организацией» (1-й семестр), а также Б1.В.ОД.2 «Бухгалтерский учет» (1-й семестр).

Знания, полученные в процессе изучения дисциплины, служат основой для освоения дисциплин Б1.В.ОД.4 «Инвестиционный менеджмент» (3-й семестр), Б1.В.ОД.7 «Стратегия развития предприятия» (3-й семестр).

Объем ДИСЦИПЛИНЫ

Вид учебных занятий и самостоятельная работа		Объем ДИСЦИПЛИНЫ, час.												
		Всего	Семестр											
			1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
Очная форма обучения														
Контактная работа обучающихся с преподавателем, в том числе:		18		18										
лекционного типа (Л)		6		6										
лабораторные работы (практикумы) (ЛР)														
практического (семинарского) типа (ПЗ)		12		12										
контролируемая самостоятельная работа обучающихся (КСР)														
Самостоятельная работа обучающихся (СР)		54		54										
Промежуточная аттестация	форм а	заче т												
	час.													
Общая трудоемкость (час. / з.е.)		72/2		72 /2										

3. Содержание и структура дисциплины

Очная форма обучения

№ п/п	Наименование тем (разделов)	Объем дисциплины (модуля), час.						Форма текущего контроля успеваемости ⁴ , промежуточной аттестации
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий				СР	
			Л	ЛР	ПЗ	КСР		
Очная форма обучения								
Тема 1	Риск: основные понятия и концепции	20	2		4		14	ПЗ
Тема 2	Методы оценки рисков (ISO/IEC 31010:2009 «Управление рисками - методы оценки рисков)	26	2		4		20	ПЗ
Тема 3	Интегрированная концепция внутреннего контроля и управления рисками Комитета спонсорских организаций Комиссии Тредвея/KOCO 1992, 2004, 2013 (COSO	26	2		4		20	ПЗ

№ п/п	Наименование тем (разделов)	Объем дисциплины (модуля), час.						Форма текущего контроля успеваем ости ⁴ , промежут
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий				С Р	
			Л	ЛР	ПЗ	КСР		
Очная форма обучения								
	(ERM/IC))							
Промежуточная аттестация		Зачет						
Всего:		72	6		12		54	

формы текущего контроля успеваемости: практические задания (ПЗ).

Содержание дисциплины

Тема 1. Риск: основные понятия и концепции

Конечная цель риск-менеджмента заключается в получении наибольшей выгоды при оптимальном, приемлемом для предпринимателя соотношении доходов, расходов и риска.

Риск-менеджмент представляет собой систему управления риском и экономическими, точнее, финансовыми отношениями, возникающими в процессе этого управления. Риск-менеджмент включает в себя стратегию и тактику управления.

Под стратегией управления понимаются направление и способ использования средств для достижения поставленной цели. Этому способу соответствует определенный набор правил и ограничений для принятия решения. Стратегия позволяет сконцентрировать усилия на вариантах решения, не противоречащих принятой стратегии, отбросив все другие варианты.

Тактика - это конкретные методы и приемы для достижения поставленной цели в конкретных условиях. Задачей тактики управления является выбор оптимального решения и наиболее приемлемых в данной хозяйственной ситуации методов и приемов управления.

Основные понятия: риск и неопределенность, знания и информация, шум и сигнал, прогнозы, международные и российские стандарты и практики управления риском и внутреннего аудита.

Тема 2. Методы оценки рисков (ISO/IEC 31010:2009 «Управление рисками - методы оценки рисков»)

Изучение инструментария и алгоритмов анализа с выполнением самостоятельных заданий.

Анализ и оценка рисков.

1) Идентификация - представляет процесс, при котором выявляется подверженность компании неизвестности, рискам (стратегические, операционные, финансовые, управление знаниями и информацией, регулятивные).

2) Описание - заключается в подробном описании выявленных рисков,

3) Измерение - можно количественным, качественным или смешанным способом.

4) Методы и технологии анализа рисков. Некоторые из них применимы только для положительных или негативных рисков, другие – для всех видов.

5) Карта рисков (Risk Profile).

Качественная/количественная оценка рисков.

Мероприятия по управлению рисками.

Мониторинг.

Основные понятия: анализ сценариев, чувствительности, стресс-тестирование, опциональность и дерево решений, метод Монте Карло, а также прочие методы выявления, оценки и мониторинга рисков

Тема 3. Интегрированная концепция внутреннего контроля и управления рисками Комитета спонсорских организаций Комиссии Тредвея/KOSO 1992, 2004, 2013 (COSO (ERM/IC))

Совместная работа над кейсом «Проектирование системы управления рисками компании».

Основные понятия: 8 компонентов системы управления рисками: внутренняя среда, постановка целей, определение событий, оценка рисков, реагирование на риск, средства контроля, информация и коммуникации, мониторинг.

4. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся и фонд оценочных средств промежуточной аттестации по дисциплине

4.1. Формы и методы текущего контроля успеваемости обучающихся и промежуточной аттестации.

4.1.1. В ходе реализации дисциплины Б1.В.ДВ.1.3 «Управление рисками» используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

Тема и/или раздел	Методы текущего контроля успеваемости
Риск: основные понятия и концепции	Практические задания
Методы оценки рисков (ISO/IEC 31010:2009 «Управление рисками - методы оценки рисков»)	Практические задания
Интегрированная концепция внутреннего контроля и управления рисками Комитета спонсорских организаций Комиссии Тредвея/KOSO 1992, 2004, 2013 (COSO (ERM/IC))	Практические задания

4.1.2. Зачет по дисциплине Б1.В.ДВ.1.3 «Управление рисками» для выявления уровня освоения компетенции проводится в устной форме.

4.2. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся.

Типовые оценочные материалы

Тема 1. Риск: основные понятия и концепции

Примеры практический заданий

1. Из изученных ранее курсов перечислите и запишите известные вам модели управления, контроля, принятия решений (подходы, системы, инструментарий), которые могут быть использованы для управления рисками.
2. Постройте матрицы (используемая модель/ определение риска)

Тема 2. Методы оценки рисков (ISO/IEC 31010:2009 «Управление рисками - методы оценки рисков»)

Примеры практический заданий

1. Постройте на основании входных данных дерево решений.
2. Определите чувствительность и границы отклонений по факторам риска.
3. Предложите варианты сценарного анализа и факторов риска на основе стратегии компании.
4. Определите ключевые факторы. Постройте модель: входные параметры - выходное значение.
5. Проведите исследование (опрос экспертов по значениям ключевых факторов).
6. Проведите экспертную оценку.
7. Постройте диаграмму торнадо.
8. Выделите алгоритм работы с рисками компании (проекта):
 - драйверы стоимости
 - анализ чувствительности
 - сценарный анализ
 - моделирование Монте Карло (по желанию)

Тема 3. Интегрированная концепция внутреннего контроля и управления рисками Комитета спонсорских организаций Комиссии Тредвея/KOCO 1992, 2004, 2013 (COSO (ERM/IC))

Примеры практический заданий

Кейс «Проектирование системы управления рисками компании»

Выберите компанию для анализа (желательно публичную, чтобы облегчить поиск информации в сети Интернет т.п.). Необходимо наличие отчетности, краткого описания деятельности по бизнес-модели и т.п. Постройте бизнес-модель и финансовую модель компании. Рассчитайте основные технико-экономические и финансовые показатели (объясните причину выбора набора показателей).

По анализируемой компании постройте дерево решений. С самостоятельной постановкой задачи для принятия управленческого решения. При необходимости проведите сценарное моделирование, расчет чувствительности, стресс-тестирование, имитационное моделирование (по выбору).

4.3. Оценочные средства для промежуточной аттестации.

4.3.1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы. Показатели и критерии оценивания компетенций на различных этапах их формирования

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
ПК-1	способностью управлять организациями, подразделениями, группами (командами) сотрудников, проектами и сетями	ПК-1.2	способность управлять группами (командами) сотрудников, подразделениями, организациями в профессиональной деятельности

ПК-3	способность использовать современные методы управления корпоративными финансами для решения стратегических задач	ПК-3.1	способность использовать современные методы управления корпоративными финансами в процессе разработки бизнес плана в профессиональной деятельности
------	---	--------	--

Этап освоения компетенции	Показатель оценивания	Критерий оценивания
ПК-1.2 способность управлять группами (командами) сотрудников, подразделениями, организациями в профессиональной деятельности	Применяет основные методы и принципы делегирования полномочий и ответственности в трудовом коллективе Владеет средствами информационных технологий в практике разработки и реализации бизнес-планов в профессиональной деятельности Использует методы и инструменты управления рисками для принятия управленческих решений по реализации конкретных проектов и решений в профессиональной деятельности	Грамотно применяет основные методы и принципы делегирования полномочий и ответственности в трудовом коллективе Корректно применяет методику составления и практической реализации бизнес- плана с использованием информационных технологий Корректно применяет методы и инструменты управления рисками для принятия управленческих решений по реализации конкретных проектов и решений в профессиональной деятельности
ПК-3.1 способность использовать современные методы управления корпоративными финансами в процессе разработки бизнес плана в профессиональной деятельности	Анализирует и интерпретирует финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся во всех видах отчетности, включая внутреннюю, для использования при принятии управленческих решений Применяет информационные технологии для решения управленческих задач Использует программное	Грамотно анализирует и интерпретирует финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся во всех видах отчетности, включая внутреннюю, для использования при принятии управленческих решений Обоснованно и грамотно применяет информационные технологии для решения

	<p>обеспечение для работы с деловой информацией и основами Интернет-технологий.</p> <p>Обладает навыками работы с информационными технологиями для решения стратегических задач управления корпоративными финансами в профессиональной деятельности</p> <p>Выбирает из арсенала современных методов корпоративного управления методы, учитывающие специфику стратегических задач управления корпоративными финансами</p> <p>Разрабатывает бизнес-план для действующего или вновь создаваемого предприятия в профессиональной деятельности</p> <p>Использует программные продукты при разработке бизнес-плана</p>	<p>управленческих задач</p> <p>Свободно и компетентно использует программное обеспечение для работы с деловой информацией и основами Интернет-технологий.</p> <p>Обладает отработанными навыками работы с информационными технологиями для решения стратегических задач управления корпоративными финансами в профессиональной деятельности</p> <p>Правильно обосновывает выбор из арсенала современных методов корпоративного управления методов, учитывающих специфику стратегических задач управления корпоративными финансами</p> <p>Самостоятельно разрабатывает бизнес-план для действующего или вновь создаваемого предприятия в профессиональной деятельности</p> <p>Грамотно использует программные продукты при разработке бизнес-плана</p>
--	--	---

4.3.2 Типовые оценочные средства

Типовые контрольные задания или иные материалы (типовые оценочные материалы), необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций (ПК-1.2, ПК-3.1) в процессе освоения образовательной программы.

Вопросы к зачету по дисциплине Б1.В.ДВ.1.3 «Управление рисками»

1. Понятие риска и неопределенности
2. Источники неопределенностей
3. Классификация лиц, принимающих решение по их отношению к риску
4. Понятие шум и сигнал, знание и информация
5. Методология и этапы риск-анализа инвестиционного проекта
6. Этапы построения системы управления рисками компании
7. Внешние по отношению к компании риски
8. Определение приоритетов и целей риск-менеджмента на стратегическом уровне
Определение стратегии компании в части управления рисками
9. Установление (проявление) риск-аппетита на стратегическом уровне

10. Компоненты системы управления рисками: внутренняя среда
11. Компоненты системы управления рисками: постановка целей
12. Компоненты системы управления рисками: определение событий
13. Компоненты системы управления рисками: оценка рисков
14. Анализ и оценка рисков: алгоритмы и методы идентификации рисков
15. Анализ и оценка рисков: способы описания рисков
16. Анализ и оценка рисков: способы измерения рисков (количественные, качественные, смешанные)
17. Анализ и оценка рисков: методы и технологии анализа рисков (для положительных и негативных рисков)
18. Анализ и оценка рисков: карта рисков
19. Анализ и оценка рисков: качественная и количественная оценка рисков
20. Компоненты системы управления рисками: реагирование на риск
21. Компоненты системы управления рисками: информация и коммуникации
22. Компоненты системы управления рисками: мониторинг и мероприятия по управлению рисками
23. Инструментарий: матричный анализ для оценки рисков (матрица последствий/вероятностей и т.д.)
24. Инструментарий: опциональность, построение и анализ дерева решений
25. Инструментарий: достоинства и недостатки метода экспертных опросов.
26. Инструментарий: анализ отклонений по факторам риска и стресс-тестирование
27. Инструментарий: сценарный анализ и выявление факторов риска на основе стратегии компании, структурированный анализ сценариев методом «что, если»
28. Инструментарий: метод вариации параметров, анализ чувствительности.
29. Инструментарий: имитационное моделирование, моделирование Монте Карло (основные положения, алгоритм проведения, анализ результатов)
30. Инструментарий: особенности использования SWOT-анализа как инструмента риск-анализа.
31. Инструментарий: способы визуализации (диаграмма торнадо, паука и т.д.)
32. Инструментарий: структура описания выявленных рисков (таблица рисков и т.д.)

Промежуточная аттестация студентов проводится в соответствии с Уставом Академии, Положением о промежуточной аттестации студентов по программам ВО. Промежуточная аттестация проводится в соответствии с Учебным планом в 2 семестре в форме зачета. Студенты допускаются к зачету по дисциплине в случае выполнения им учебного плана по дисциплине: выполнения всех заданий и мероприятий, предусмотренных программой дисциплины (по формам текущего контроля) и выполненных работ. В случае наличия учебной задолженности студент отрабатывает пропущенные занятия в соответствии с требованиями преподавателя.

Объектами оценивания выступают:

- учебная дисциплина (активность на занятиях, своевременность выполнения различных видов заданий, посещаемость всех видов занятий по аттестуемой дисциплине);
- степень усвоения теоретических знаний;
- уровень овладения практическими умениями и навыками по всем видам учебной работы;
- результаты самостоятельной работы.

Активность студента на занятиях оценивается по его выступлениям по вопросам практических занятий, на дискуссиях, диспутах, круглых столах.

Оценка знаний студента на зачете носит комплексный характер, является балльной и определяется его:

- ответом на зачете (максимум 40 баллов);

- учебными достижениями в семестровый период (максимум 60 баллов).

Знания, умения, навыки студента на зачете оцениваются в соответствии с балльно-рейтинговой системой. Основой для определения оценки служит уровень усвоения студентами материала, предусмотренного данной рабочей программой.

Шкала оценивания

Шкала 1. Оценка сформированности отдельных элементов компетенций

Обозначения		Формулировка требований к степени сформированности компетенции		
Цифр	Оценка	Знать	Уметь	Владеть
1	Не зачтено	Отсутствие знаний	Отсутствие умений	Отсутствие навыков
2	Не зачтено	Фрагментарные знания	Частично освоенное умение	Фрагментарное применение
3	Зачтено	Общие, но не структурированные знания	В целом успешное, но не систематически осуществляемое умение	В целом успешное, но не систематическое применение
4	Зачтено	Сформированные, но содержащие отдельные пробелы знания	В целом успешное, но содержащие отдельные пробелы умение	В целом успешное, но содержащее отдельные пробелы применение навыков
5	Зачтено	Сформированные систематические знания	Сформированное умение	Успешное и систематическое применение навыков

Шкала 2. Комплексная оценка сформированности знаний, умений и владений

Обозначения		Формулировка требований к степени сформированности компетенции
Цифр	Оценка	
1	Не зачтено	Не имеет необходимых представлений о проверяемом материале
2	Не зачтено	Знать на уровне ориентирования , представлений. Субъект учения знает основные признаки или термины изучаемого элемента содержания, их отнесенность к определенной науке, отрасли или объектам, узнает их в текстах, изображениях или схемах и знает, к каким источникам нужно обращаться для более детального его усвоения
3	Зачтено	Знать и уметь на репродуктивном уровне. Субъект учения знает изученный элемент содержания репродуктивно: произвольно воспроизводит свои знания устно, письменно или в демонстрируемых действиях
4	Зачтено	Знать, уметь, владеть на аналитическом уровне. Зная на репродуктивном уровне, указывать на особенности и взаимосвязи изученных объектов, на их достоинства, ограничения, историю и перспективы развития и особенности для разных объектов усвоения
5	Зачтено	Знать, уметь, владеть на системном уровне. Субъект учения

		знает изученный элемент содержания системно, произвольно и доказательно воспроизводит свои знания устно, письменно или в демонстрируемых действиях, учитывая и указывая связи и зависимости между этим элементом и другими элементами содержания учебной дисциплины, его значимость в содержании учебной дисциплины
--	--	---

4.4. Методические материалы

Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенции ПК ОС-3.1.

Критерии оценки результатов текущего контроля успеваемости (в сумме максимум 60 баллов):

Критерии оценки работ, выполняемых на семинарских и практических занятиях – максимальная оценка за каждое задание – 10 баллов.

Процент лекций и семинарских занятий, посещенных студентом (бонус за посещаемость более 90%) - 5 баллов.

Работа на семинарском занятии (участие в обсуждении вопросов рассматриваемой темы) - 1 балл за полностью раскрытый вопрос.

Выполнение индивидуальных заданий: баллы выставляются исходя из качества выполнения заданий – максимальная сумма баллов - 10.

Баллы по текущей работе доводятся до обучающихся в начале изучения дисциплины.

Итоговая сумма баллов по промежуточной аттестации студентов складывается из суммы баллов, полученных ими по результатам текущего контроля успеваемости и количества баллов по промежуточной аттестации. Оценка «зачтено» выставляется студенту, набравшему в сумме не менее 61 баллов.

Показатели, критерии и оценивания знаний и компетенций на зачете

Уровень	Критерии	Баллы
Высокий	Студент показывает отличные знания изученного учебного материала; самостоятельно, логично и последовательно излагает и интерпретирует материалы учебного курса; полностью раскрывает смысл предлагаемого вопроса; владеет основными терминами и понятиями изученного курса; показывает умение переложить теоретические знания на предполагаемый практический опыт	31-40
Хороший	Студент показывает хорошие знания изученного учебного материала; самостоятельно, логично и последовательно излагает и интерпретирует материалы учебного курса; почти полностью раскрывает смысл предлагаемого вопроса; владеет основными терминами и понятиями изученного курса; в основном показывает умение переложить теоретические знания на предполагаемый практический опыт	21-30
Средний	Студент показывает не очень хорошие знания изученного учебного материала; слабо излагает и интерпретирует материалы учебного курса; кратко раскрывает смысл предлагаемого вопроса; владеет основными терминами и понятиями изученного курса; практически отсутствует умение переложить теоретические знания на предполагаемый практический опыт	11-20

Низкий	При наличии серьезных упущений в процессе изложения учебного материала; в случае отсутствия знаний основных понятий и определений курса или присутствии большого количества ошибок при интерпретации основных определений; если студент показывает значительные затруднения при ответе на предложенные основные и дополнительные вопросы; при условии отсутствия ответа на основной и дополнительный вопросы	10 балл и ниже
--------	--	----------------

Максимальное количество баллов, которое студент может набрать в процессе обучения в рамках учебного курса – **100 баллов**:

91-100 баллов	зачтено	(A)
81-90 баллов	зачтено	(B)
71-80 баллов	зачтено	(C)
61-70 баллов	зачтено	(D)
60 и менее	не зачтено	(E).

5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Занятия по дисциплине представлены следующими видами работ: лекциями, практическими занятиями, самостоятельной работой студентов.

В рамках самостоятельной работы студенты готовят самостоятельно вопросы, готовятся к практическим занятиям: проводят обзор интернет-сайтов, периодической литературы и профессиональных изданий, разрабатывают каталог интернет-ресурсов, осуществляют подготовку к разработке групповых проектов по заданной теме, к зачету.

Основными видами самостоятельной работы являются:

- повторение лекционного материала и материала учебников;
- чтение основной и дополнительной литературы
- самостоятельное изучение дидактических единиц, расширяющих знания по изучаемой тематике дисциплины;
- подготовка к практическим занятиям;
- подготовка к промежуточной и итоговой аттестации.

Процедура подготовки к лекциям:

На занятиях лекционного типа студентам рекомендуется внимательно слушать и конспектировать лекции. Краткие записи лекций, их конспектирование помогает усвоить учебный материал. Конспект является полезным тогда, когда записано самое существенное, основное и сделано это самим студентом. Желательно запись осуществлять на одной странице, а следующую оставлять для проработки учебного материала самостоятельно в домашних условиях. Конспект лекции лучше подразделять на пункты, параграфы, соблюдая красную строку. Этому в большой степени будут способствовать пункты плана лекции, предложенные преподавателям. Принципиальные места, определения, формулы и другое следует сопровождать замечаниями «важно», «особо важно», «хорошо запомнить» и т.п. Можно делать это и с помощью разноцветных маркеров или ручек. Работая над конспектом лекций, всегда необходимо использовать не только учебник, но и ту литературу, которую дополнительно рекомендовал лектор.

Процедура подготовки к практическим занятиям:

На практических занятиях студенты выполняют задания, связанные с изучением и обсуждением ключевых вопросов общего менеджмента, выступлением и участием в дискуссиях, диспутах, решением задач, анализом кейсов и практических ситуаций.

При подготовке к практическим занятиям обучающимся рекомендуется:

1. Внимательно изучить вопрос/вопросы (задание).

2. Прочитать рекомендованную литературу и материалы лекции по соответствующей теме.
3. Найти соответствующие информационные источники.
4. Сформировать комплект материалов (лекционных, учебно-методических, законодательно-нормативных) по выбранному вопросу (заданию).
5. Составить план ответа (доклада, презентации).
6. Весь материал (статистику, информацию на сайтах, литературные источники, как на русском, так и на иностранных языках) обработать и использовать реферативно.
7. Указать авторство использованных материалов.
8. При чтении литературы кратко конспектировать основные положения статьи или главы.
8. Не использовать рефераты и курсовые, размещенные на internet-ресурсах.
9. Планировать свой ответ (доклад, презентацию) по времени.
10. Не пересказывать материал, а презентовать свои выводы и заключения, доказывая и/или иллюстрируя их конкретными экономическими примерами, результатами расчетов, произведенных самостоятельно на основе использования российских и международных баз экономической информации.
11. При работе в малых группах в начале работы четко распределить обязанности.

Процедура подготовки к промежуточной аттестации:

Каждый учебный семестр заканчивается зачетно-экзаменационной сессией. Подготовка к зачетно-экзаменационной сессии, сдача зачетов и экзаменов является также самостоятельной работой студента. Основное в подготовке к сессии – повторение всего учебного материала дисциплины, по которому необходимо сдавать зачет или экзамен. Только тот студент успевает, кто хорошо усвоил учебный материал. Если студент плохо работал в семестре, пропускал лекции, слушал их невнимательно, не конспектировал, не изучал рекомендованную литературу, то в процессе подготовки к сессии ему придется не повторять уже знакомое, а заново в короткий срок изучать весь учебный материал. Все это зачастую невозможно сделать из-за нехватки времени. Для такого студента подготовка к зачету или экзамену будет трудным, а иногда и непосильным делом, а конечный результат – возможное отчисление из учебного заведения.

6. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

6.1. Основная литература.

1. Балдин К.В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С.— Электрон. текстовые данные. М.: Дашков и К, 2015. <http://www.iprbookshop.ru/14110>
2. Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 1 : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / П. Г. Белов. — М. : Издательство Юрайт, 2017. — 211 с. — (Серия : Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-02606-1. — Режим доступа : www.biblio-online.ru/book/975C78A8-9A75-4373-9BC2-F72CF8DB3AD9.
3. Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 2 : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / П. Г. Белов. — М. : Издательство Юрайт, 2017. — 250 с. — (Серия : Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-02608-5. — Режим доступа : www.biblio-online.ru/book/2A88AA7C-B0DC-4A93-83AC-85ED6466BBDC.

4. Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 3 : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / П. Г. Белов. — М. : Издательство Юрайт, 2017. — 272 с. — (Серия : Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-02609-2. — Режим доступа : www.biblio-online.ru/book/E46BB19F-87E3-4034-9788-51EF95A24F56.

6.2. Дополнительная литература.

1. Воробьев, С.Н. Управление рисками в предпринимательстве, 4-е изд., испр. [Электронный ресурс] : / С.Н. Воробьев, К.В. Балдин. — Электрон. дан. М. : Дашков и К, 2013. http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=50264
2. Алексеенко В.Б Управление рисками в производственно-хозяйственной деятельности предприятия [Электронный ресурс]: учебно-методическое пособие/ Алексеенко В.Б., Кутлыева Г.М., Мочалова Ю.И.— Электрон. текстовые данные. М.: Российский университет дружбы народов. 2013. <http://www.iprbookshop.ru/22224>
3. Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / А. В. Воронцовский. — М. : Издательство Юрайт, 2017. — 414 с. — (Серия : Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-00945-3. — Режим доступа : www.biblio-online.ru/book/E098C311-CAA9-4FD5-AC72-5F801419DD64.

6.3 Нормативные правовые документы.

1.Федеральное законодательство РФ:

Конституция РФ;

Гражданский кодекс РФ;

Налоговый кодекс РФ;

Федеральный закон «Об акционерных обществах»;

Федеральный закон «Об обществах с ограниченной ответственностью»;

2.Международные стандарты по риск-менеджменту и смежным вопросам:

Стандарт управления риском Федерации европейских ассоциаций риск-менеджеров (A Risk Management Standard, FERMA), 2004 г.;

Международный стандарт ISO 31000:2009 «Управление рисками. Принципы и руководящие указания», ISO 73:2009 «Управление рисками. Словарь», ISO/IEC 31010:2009 «Управление рисками – методы оценки рисков», 2009 г., Международный стандарт ISO 31004 (draft) Управление рисками – Руководство по внедрению ISO 31000, 2012г.;

Стандарты COSO «Интегрированные системы управления риском на предприятиях», Комитет спонсорских организаций Комиссии Тредвей (Standard COSO, ERM – Integrated Framework), 2004 г.;

Международные профессиональные стандарты внутреннего аудита, Институт внутренних аудиторов (International standards for the professional practice of internal auditing ,The Institute of Internal Auditors);

Практическое руководство Института внутренних аудиторов Оценка адекватности управления рисками, на основе стандарта ИСО 31000 (Assessing the Adequacy of Risk Management Using ISO 31000, The Institute of Internal Auditors), 2010 г.

3.Международные документы:

Рекомендации и материалы Группы экспертов по риск-менеджменту в системах нормативного регулирования Европейской экономической комиссии, включая Манифест —Конвергенция финансового риск-менеджмента (FRM) и риск-менеджмента организаций (ERM) Financial Risk Management (FRM) and Enterprise Risk-Management (ERM) Convergence (Manifesto), 2011г.

Руководство для советов директоров и комитетов по аудиту, «Мониторинг эффективности системы внутреннего контроля, внутреннего аудита и управления рисками» (Guidance for boards and audit committees «Monitoring the effectiveness of internal control, internal audit and risk management systems»); 8th European Company Law Directive on Statutory Audit, 2010 г.; Практические указания COSO, «Всеобъемлющий риск-менеджмент организации», (Embracing Enterprise Risk Management: Practical Approaches for Getting Started), 2011 г.; Лучшие практики СVP, документ COSO, Разработка ключевых индикаторов риска для укрепления СVP (Developing Key Risk Indicators to Strengthen Enterprise Risk Management), 2010 г.

4. Национальные стандарты по управлению рисками

ГОСТ Р ИСО 31000-2010 Менеджмент риска. Принципы и руководство;
ГОСТ Р ИСО/МЭК 31010-2011 Менеджмент риска. Методы оценки риска;
ГОСТ Р 51897-2011/Руководство ИСО 73:2009 Менеджмент риска. Термины и определения;
ГОСТ Р 51901.12-2007 (МЭК 60812:2006) Менеджмент риска. Метод анализа видов и последствий отказов;
ГОСТ Р 51901.14-2007 (МЭК 61078:2006) Менеджмент риска. Структурная схема надежности и булевы методы;
ГОСТ Р 51901.16-2005 (МЭК 61164:1995) Менеджмент риска. Повышение надежности. Статистические критерии и методы оценки;
ГОСТ Р 51901.15-2005 (МЭК 61165:1995) Менеджмент риска. Применение марковских методов;
ГОСТ Р 54142-2010 Менеджмент рисков. Руководство по применению организационных мер безопасности и оценки рисков. Методология построения универсального дерева событий.

5.Международные и национальные документы по стандартам социальной ответственности, социальной отчетности и регулированию вопросов устойчивого развития:

Стандарт ИСО 26000:2010 «Руководство по социальной ответственности»;
Руководство по отчетности в области устойчивого развития, Глобальная инициатива по отчетности (Global Reporting Initiative, GRI);
Стандарт заверения нефинансовых отчетов AA 1000 AS Института социальной и этической отчетности (Institute of Social and Ethical AccountAbility);
Стандарт взаимодействия с заинтересованными сторонами AA1000 SES Института социальной и этической отчетности (Institute of Social and Ethical AccountAbility);
Проект ГОСТ Р «Менеджмент организации. Руководство по обеспечению устойчивого развития».

6. Международные и национальные стандарты по управлению непрерывностью бизнеса

Стандарт по управлению непрерывностью бизнеса BS 25999 (Business Continuity Management, BCM);

ГОСТ Р 53647.1-2009 Менеджмент непрерывности бизнеса. Часть 1. Практическое руководство;

ГОСТ Р 53647.2-2009 Менеджмент непрерывности бизнеса. Часть 2. Требования;

ГОСТ Р 53647.3-2010 Менеджмент непрерывности бизнеса. Часть 3. Руководство по внедрению;

проект ГОСТ Р 53647.5 «Менеджмент непрерывности бизнеса. Готовность к опасным ситуациям и инцидентам»;

ГОСТ Р 53647.6 «Менеджмент непрерывности бизнеса. Требования к системе менеджмента персональной информации для обеспечения защиты данных».

7. Международные и национальные стандарты по управлению рисками проектов

Практический стандарт по управлению рисками проекта (Practice Standard for Project Risk Management), Project Management Institute;

ГОСТ Р 51901.4-2005 (МЭК 62198:2001) Менеджмент риска. Руководство по применению при проектировании;

ГОСТ Р 52806-2007 Менеджмент рисков проектов. Общие положения;

ГОСТ Р МЭК 61160-2006 Менеджмент риска. Формальный анализ проекта.

8. Международные стандарты и квалификационные минимумы по профессии риск-менеджера

Основные знания по темам, входящим в квалификационные минимумы для сдачи экзаменов FRM (Financial Risk Manager, GARP) и PRM (Professional Risk Manager, PRMIA);

Стандарт ONR 49003 «Требования к квалификации риск менеджера». Внедрение стандартов серии ИСО 31000 (ONR 49003 Requirements for the qualification of the risk manager).

6.4 Интернет-ресурсы, Информационные справочные системы

Научная библиотека РАНХиГС. URL: <http://lib.ranepa.ru/>

Научная электронная библиотека eLibrary.ru. URL: <http://elibrary.ru/defaultx.asp>

Национальная электронная библиотека. URL: www.nns.ru

Российская государственная библиотека. URL: www.rsl.ru

Российская национальная библиотека. URL: www.nnir.ru

Электронная библиотека Grebennikon. URL: <http://grebennikon.ru>

Электронно-библиотечная система Издательства «Лань». URL: <http://e.lanbook.com>

Электронно-библиотечная система ЮПАЙТ. URL: <http://www.biblio-online.ru/>

7. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы

Для проведения занятий по дисциплине необходимо следующее материально-техническое обеспечение: учебные аудитории для проведения занятий лекционного и семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, для самостоятельной работы: читальные залы библиотеки.

Программное обеспечение: MS Office Professional Plus 2016, программа «Antiplagiat.ru», программа «Project Expert» for Windows.

Информационные справочные системы: Научная библиотека РАНХиГС. URL: <http://lib.ranepa.ru/>; Научная электронная библиотека eLibrary.ru. URL: <http://elibrary.ru/defaultx.asp>; Национальная электронная библиотека. URL: www.nns.ru; Российская государственная библиотека. URL: www.rsl.ru; Российская национальная библиотека. URL: www.nnir.ru; Электронная библиотека Grebennikon. URL: <http://grebennikon.ru/>; Электронно-библиотечная система Издательства «Лань». URL:

<http://e.lanbook.com>; Электронно-библиотечная система ЮРАЙТ. URL: <http://www.biblio-online.ru/>.