

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

Институт управления и регионального развития
Факультет маркетинга и международного сотрудничества
(наименование института/факультета)

Кафедра «Финансы и страхование»
(наименование кафедры)

УТВЕРЖДЕНА

Ученым советом ФИММ

протокол от «05» сентября 2018 г. № 4

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Б1.В.ДВ.01.02 Стратегическая система управления рисками
(индекс, наименование дисциплины (модуля), в соответствии с учебным планом)

направление подготовки (специальность)
38.04.02 «Менеджмент»

(код, наименование направления подготовки (специальности))

«Риск - менеджмент и страховой бизнес»
направленность (профиль)
Квалификация выпускника: МАГИСТР
(квалификация)

Форма обучения – очно-заочная
(форма(ы) обучения)

Год набора 2019

Москва 2018г.

Автор–составитель: Курасов Валерий Валентинович

К. Т. Н.

(ученая степень и(или) ученое звание, должность) (наименование кафедры)

Заведующий кафедрой

«Финансы и страхование»

(наименование кафедры)

Д.Э.Н.

(ученая степень)

подпись

А. С. Миллерман

(Ф.И.О.)

СОДЕРЖАНИЕ

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы.....	4
2. Объем и место дисциплины в структуре образовательной программы.....	5
3. Содержание и структура дисциплины	5
4. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся и фонд оценочных средств промежуточной аттестации по дисциплине	8
5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины	11
6. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающихся по дисциплине	12
6.1. Основная литература.....	
6.2. Дополнительная литература.....	
6.3. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы.....	
6.4. Нормативные правовые документы.....	
6.5. Интернет-ресурсы.....	
6.6. Иные источники.....	
7. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы	14

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

1.1. Дисциплина Б1.В.ДВ.01.02 «Стратегическая система управления рисками» обеспечивает овладение следующими компетенциями:

-способность разрабатывать корпоративную стратегию, программы организационного развития и изменений и обеспечивать их реализацию ПК-2.2 2 этап

1.2. В результате освоения дисциплины у магистрантов должны быть сформированы:

ОТФ/ТФ (при наличии профстандарта)/трудовые или профессиональные действия	Код этапа освоения компетенции	Результаты обучения
Способность разрабатывать корпоративную стратегию, программы организационного развития и изменений и обеспечивать их реализацию	ПК-2.2 2 этап	знать: - комплекс теоретических знаний, необходимых для разработки корпоративных систем интегрированного управления рисками нефинансовых компаний, направленных на увеличение их стоимости; - комплекс знаний в области качественного и количественного анализа корпоративных рисков с использованием инструментария Corporate Risk (Corporate Metrics); - методы разработки и функционирования корпоративных систем интегрированного управления рисками на основе регламентов Enterprise-Wide-Risk-Management (EWRM).
		уметь: - принимать эффективные решения по интегрированию систем управления рисками на основе системного подхода; - разрабатывать стратегии элиминирования рисков и корпоративных страховых программ; - рассчитывать на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы экономические и социально-экономические показатели; - анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий (корпораций) различных форм собственности и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений.
		владеть: - навыками разработки, обоснования и принятия корпоративных стратегий по

		управлению стоимостью компании в условиях риска и неопределенности; - практическими навыками диагностирования и картографирования релевантных рисков и техники их анализа; - современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных; - методами и приемами анализа экономических явлений и процессов с помощью стандартных теоретических и эконометрических моделей; - навыками оценки возможных источников краткосрочного и долгосрочного финансирования деятельности корпорации.
--	--	--

2. Объем и место дисциплины в структуре ОП ВО

Объем дисциплины

Количество академических часов, выделенных на контактную работу с преподавателем – 18 академических часов, включая 18 часов практических занятий (семинаров). На самостоятельную работу обучающихся предусмотрено - 54 часа. Общая трудоемкость дисциплины – 2 зачетных единицы

Место дисциплины в структуре ОП ВО

Дисциплина Б1.В.ДВ.01.02 «Стратегическая система управления рисками» является дисциплиной по выбору программы магистерской подготовки «Риск-менеджмент и страховой бизнес». В соответствии с учебным планом изучается в 2 семестре на 1 курсе.

Освоение дисциплины опирается на минимально необходимый объем теоретических знаний в области общего менеджмента, а также на приобретенные ранее умения и навыки принятия управленческих решений.

Дисциплина реализуется после изучения дисциплин: «Общий и стратегический маркетинг», «Управленческая экономика», «Математические основы финансового менеджмента».

Форма промежуточной аттестации в соответствии с учебным планом – зачет.

3. Содержание и структура дисциплины

№ п/п	Наименование тем (разделов),	Объем дисциплины (модуля), час.					Форма текущего контроля успеваемости **, промежуточной аттестации	
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий					СР
			Л/ЭО, ДОТ*	ЛР/ЭО, ДОТ*	ПЗ/ЭО, ДОТ*	КСР		
Очная форма обучения								
Тема 1	Методические основы корпоративного риск-менеджмента	8			2		6	О, Т, Д
Тема 2	Интегрированное управление рисками в	8			2		8	О, Т, Д

№ п/п	Наименование тем (разделов),	Объем дисциплины (модуля), час.						Форма текущего контроля успеваемости **, промежуточной аттестации
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий				СР	
			Л/ЭО, ДОТ*	ЛР/ЭО, ДОТ*	ПЗ/ЭО, ДОТ*	КСР		
Очная форма обучения								
	нефинансовой компании							
Тема 3	Техника диагностики рисков в компании	8			2		8	О, Т, Д
Тема 4	Оценка и анализ корпоративных рисков	10			2		8	О, Т, Д
Тема 5	Стресс-тестирование нефинансовых компаний	10			2		6	О, Т, Д
Тема 6	Экономический анализ корпоративных рисков	10			4		6	О, Т, Д
Тема 7	Элиминирование корпоративных рисков	10			2		6	О, Т, Д
Тема 8	Корпоративная система интегрированного управления рисками	8			2		6	О, Т, Д
Промежуточная аттестация								Зачет
Всего:		72			18		54	

Примечание:

** – формы текущего контроля успеваемости: опрос (О), тестирование (Т), контрольная работа (КР), коллоквиум (К), эссе (Э), реферат (Р), диспут (Д) формы промежуточной аттестации: зачёт с оценкой (ЗаО).

Содержание дисциплины

Тема 1. Методические основы корпоративного риск-менеджмента

Концепция управления рисками в компаниях реального сектора. Риск-ориентированное корпоративное управление. Экономическое содержание корпоративных рисков. Корпоративная неопределенность. Типология корпоративных рисков. Корпоративные риски: стратегический, рыночный, производственный (операционный), финансовый, инвестиционный, инновационный, риск корпоративной безопасности. Интегрированный корпоративный риск. Структурная схема дерева корпоративных рисков (Risk Breakdown Structure, RBC). Управление стоимостью корпорации в условиях риска и неопределенности. Ключевые экономические показатели компании (Key Economic Indicators, KEI). Стейкхолдеры (stakeholders) компании и риск. Корпоративная толерантность к риску. Корпоративная культура риск-менеджмента. Международные и национальные стандарты по управлению рисками (COSO, FERMA, IRM, МСФО-7, ISO-14000, ISO-31000). Corporate

risk. Эволюция теории корпоративного риск-менеджмента. Опыт внедрения систем интегрированного управления рисками в корпорациях России.

Тема 2. Интегрированное управление рисками в нефинансовой компании

Системный подход к управлению рисками. Основные принципы управления рисками. Концепция интегрированного управления рисками в компании (Enterprise-Wide-Risk-Management, EWRM). Стратегическое управление рисками. Тактическое управление рисками. Основной процесс управления рисками в компании. Кросс-функциональное управление рисками. Разработка стратегий по управлению рисками. Структура управленческих парадигм в компании. Стратегическое управление рисками и бюджетирование. Корпоративная политика по управлению рисками. Оперативное управление рисками. Мониторинг рисков. Бизнес-план риск-менеджмента. Система внутреннего контроля рисков. Aris Audit Manager. Внутренний аудит. Audit Universe. Sorbannes-Oxly Akt. Организация взаимодействия корпоративных финансов и управления рисками в современных российских корпорациях.

Тема 3. Техника диагностики рисков в компании

Методические аспекты диагностики рисков. Методы и инструменты диагностики. Экспресс-диагностика. Прогноз-диагностика. Основные процедуры диагностики корпоративных рисков. Классификация факторов риска. Портфель рискообразующих факторов. Корпоративный классификатор рисков. Идентификация релевантных рисков. Методы (способы) идентификации рисков. Идентификатор рисков. Картографирование рисков. Сигнальные карты рисков. Карта индивидуального риска. Корпоративный каталог (реестр) рисков. Особенности диагностирования и картографирования рисков в российских корпорациях.

Тема 4. Оценка и анализ корпоративных рисков

Основы измерения рисков. Система показателей оценки рисков. Классификация методов оценки рисков. Качественный анализ рисков. Значимость (существенность) рисков. Корпоративные матрицы качественной оценки рисков. Количественный анализ рисков. Методы (модели) количественного оценивания. Дисконтные методы. Вероятностно-статистические методы. Имитационное моделирование (Monte-Carlo). Стресс-тестирование и бэк-тестирование. Модели экономического анализа рисков. Состязательные задачи. Модель Вальда (maxmin). Модель Сэвиджа (minmax). Модель Гурвица. Нечёткие множества. Нейронные сети. Corporate metrics. Professional Rating Systems (ProRate).

Тема 5. Стресс-тестирование нефинансовых компаний

Концепция стресс-тестирования (Stress Testing, ST) компаний реального сектора. Основные положения теории экстремальных значений (Базель II, III). Моделирование экстремальных рискообразующих факторов. Классификация стресс-сценариев. Исторический стресс-сценарий. Методы корпоративного стресс-тестирования. Анализ ключевых экономических показателей компании (KEI). Количественная оценка последствий экстремальных событий. Корреляция между факторами риска. Анализ чувствительности ключевых экономических показателей (KEI) компании. Метод опорных точек. Метод рациональных зависимостей. Анализ сценариев развития бизнеса компании. Многофакторные стресс-сценарии. Анализ стратегий компании с использованием дерева решений. Техника построения дерева решений. MS Excel Palisade Precision Tree. Анализ безубыточности компании (Breakeven

Point Analysis, BPA). График безубыточности. Операционный рычаг. Особенности стресс-тестирования российских нефинансовых компаний.

Тема 6. Экономический анализ корпоративных рисков

Стратегическая риск-модель компании. Ключевые показатели риска (Key Risk Indicators, KRI). Экономические модели рисков. Модель приемлемого риска (ALARA). Модель акционерной добавленной стоимости (SVA). Модель экономической добавленной стоимости (EVA). Модель прибыли компании с учетом риска (EaR). Модель рисков стоимости компании (VaR). Corporate Metrics. National Economic Research Associates (NERA). Регрессионный анализ рисков. Выбор моделей экономического анализа рисков для компаний реального сектора экономики.

Тема 7. Элиминирование корпоративных рисков

Содержание процедур элиминирования рисков в компании. Стратегии элиминирования рисков. Стратегии элиминирования рисков: превентивного воздействия (up front); последующего воздействия (post hoc); принятия риска; безрисковая стратегия. Инструменты (способы) элиминирования рисков. Диверсификация. Лимитирование. Трансферт. Хеджирование. Локализация. Резервы. Страховая защита компании. Страхование рисков. Типология видов страхования рисков. Самострахование. Перестрахование. Кэптивное страхование. Страховой портфель компании. Программа элиминирования рисков (Risk Response Planning). Оценка эффективности программ элиминирования рисков в компаниях реального сектора.

Тема 8. Корпоративная система интегрированного управления рисками

Системный подход к управлению рисками в компании. Основные положения разработки систем интегрированного управления рисками (СИУР). Типовой цикл управления рисками. Организационная структура СИУР (распределительная модель; концентрированная модель). Функциональная структура СИУР. Chief Risk Officer (CRO). Основные бизнес-процессы СИУР. Мониторинг СИУР. Информация и коммуникации. Критерии эффективности СИУР. Информационные технологии управления рисками. ERM – системы. Risk Professional for Project. Risk Track. Open Plan (Welcom). Опыт функционирования систем интегрированного управления рисками в российских корпорациях.

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

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

4.1.1. В ходе реализации дисциплины Б1.В.ДВ.01.02 «Стратегическая система управления рисками» используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

– при проведении занятий лекционного типа:

Опрос

– при проведении занятий семинарского типа:

Диспут

– при проведении практических занятий:

Беседа

4.1.2. Зачёт проводится с применением следующих методов:

Промежуточная аттестация проводится в форме Зачёта.

4.2. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся.

Перечень заданий для самостоятельной работы и проведения текущего контроля.

Виды самостоятельной внеаудиторной работы, самостоятельное изучение разделов курса, повторение лекционного материала и материала учебников, подготовка к практическим занятиям, текущему контролю.

Самостоятельная работа студентов магистратуры по дисциплине Б1.В.ДВ.01.02 «Стратегическая система управления рисками» К самостоятельной работе относятся:

- **индивидуальное занятие** - слушатель работает один над конкретным заданием во внеаудиторное время;
- **консультация**, если она проводится преподавателем во внеаудиторное время;
- **тестирование**, если оно проводится в индивидуальном режиме во внеаудиторное время;
- **анализ деловых ситуаций**, если он осуществляется слушателем самостоятельно во внеаудиторное время с подготовкой письменного отчета и с участием в обсуждении ситуации в аудитории
- **подготовка устных докладов, презентаций**;
- **поиск информации** по теме с ее последующим устным представлением в аудитории, письменным изложением или использованием для выполнения конкретного задания, расчета;
- **индивидуальные и групповые исследовательские проекты**: поиск информации; обобщение и анализ информации.

Примерные темы домашних заданий:

1. Эволюция корпоративных систем риск-менеджмента.
2. Международные и национальные стандарты по управлению рисками.
3. Разработка систем интегрированного управления рисками в российских компаниях реального сектора (по отраслям).
4. Инструменты (способы) элиминирования рисков, применяемые в нефинансовых компаниях.
5. Программы страховой защиты промышленной компании (по отраслям).
6. Бизнес-процессы управления рисками и их интеграция с корпоративными стратегиями.
7. Внутренний контроль и аудит в компании: практика применения и перспективы развития.
8. Управление корпоративными рисками (операционный, инвестиционный, инновационный).
9. Законодательные инструменты управления рисками.
10. Стресс-тестирование нефинансовых компаний (по отраслям).
11. Техника диагностики рисков. Особенности картографирования в российских компаниях.

4.3. Оценочные средства для промежуточной аттестации.

4.3.1. Формируемые компетенции

- способностью разрабатывать корпоративную стратегию, программы организационного развития и изменений и обеспечивать их реализацию (ПК-2) ПК-2.2 2 этап.

4.3.2 Типовые оценочные средства

Промежуточная аттестация проводится в форме зачёта. Зачёт включает ответы на вопросы.

Список вопросов для подготовки к зачёту

1. Экономическое содержание корпоративных рисков.
2. Риск-ориентированное корпоративное управление
3. Типология корпоративных рисков.
4. Корпоративная толерантность к риску.
5. Международные и национальные стандарты по управлению рисками.
6. Corporate Risk.
7. Enterprise-Wide-Risk-Management (EWRM).
8. Корпоративные стратегии по управлению рисками.
9. Система внутреннего контроля и аудита рисков.
10. Техника диагностики рисков.
11. Идентификация релевантных рисков.
12. Картографирование рисков.
13. Классификация методов оценки и анализа рисков.
14. Качественный анализ рисков. Корпоративные матрицы оценки рисков.
15. Количественный анализ рисков (дисконтные методы).
16. Количественный анализ рисков (вероятностно-статистические методы; метод Monte-Carlo).
17. Количественный анализ рисков (состязательные задачи Вальда, Сэвиджа, Гурвица).
18. Стресс-тестирование нефинансовых компаний.
19. Анализ сценариев развития бизнеса компании в условиях риска.
20. Разработка корпоративных стратегий с использованием дерева решений.
21. Анализ чувствительности ключевых экономических показателей (KEI) компании.
22. Экономический анализ рисков.
23. Value-at-Risk (VaR).
24. Cashflows-at-Risk (CFaR).
25. Earnings-at-Risk (EaR).
26. Стратегии элиминирования рисков.
27. Инструменты (способы) элиминирования рисков.
28. Страховая защита компании.
29. Типология видов страхования рисков компаний реального сектора.
30. Самострахование. Перестрахование.
31. Корпоративная система интегрированного управления рисками (СИУР): основные положения.
32. Организационная структура СИУР.
33. Функциональная структура СИУР.
34. Chief Risk Officer (CRO).
35. Критерии эффективности СИУР.
36. ERM-системы.

Шкала оценивания.

Оценочным средством промежуточной аттестации является накопительная оценка результатов выполнения текущего контроля по дисциплине.

Максимальный накопленный балл, который может быть достигнут студентом по дисциплине (включая зачёт), **составляет 100 баллов**. Конечный балл, набранный студентом в течение семестра, определяется суммированием полученных баллов по следующим позициям:

	Вид работы	максимально возможный набранный балл
1.	работа на лекциях - посещение - опрос-контроль	0,5б.*8л.=4б. 0,5б.*8л.=4б.
2.	работа на практических занятиях - посещение - опрос - практические задания	1б.*8пр.=8б. 1б.*8пр.=8б. 6б*4з.=24б.
3.	диспут	0-22б.
4.	Зачёт	0-30б.

Для определения конечной оценки по дисциплине набранные студентом баллы переводятся из 100-бальной шкалы в 5-бальную по следующей схеме:

от 0 до 50 включительно	от 51 до 69 включительно	от 70 до 84 включительно	от 85 до 100 включительно
«неудовлетворительно» - 2	«удовлетворительно» - 3	«хорошо» - 4	«отлично» - 5

4.4. Методические материалы

Процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций проводятся в соответствии с Уставом Академии (утв. Постановлением Правительства Российской Федерации от 12.05.2012 г. N 473), Положением о текущем контроле успеваемости и промежуточной аттестации студентов в РАНХиГС (утв. Приказом ректора от 25.01.2012 г. № 01-349; изм. от 07.06.2013 г.), Порядком организации и проведения практики студентов, осваивающих в РАНХиГС образовательные программы высшего образования – программы бакалавриата, программы специалитета, программы магистратуры (утв. Приказом ректора от 11.05.2016 г. №01-2212).

В части обеспечения освоения дисциплины обучающимся предоставляется раздаточный материал по темам дисциплины.

Процедура оценивания знаний, умений и навыков, обеспечивающих формирование компетенций, предусмотренных освоением дисциплины, включает:

- проведение тестирования на основе тестов, включающих теоретические вопросы и расчетные примеры;
- проведение опроса по ключевым вопросам, охватывающему содержание дисциплины

5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Для обеспечения освоения дисциплины обучающиеся учебным планом предусмотрена самостоятельная работа и практические занятия.

Виды самостоятельной внеаудиторной работы:

- самостоятельное изучение разделов курса,
- повторение лекционного материала и материала учебников,
- подготовка к практическим занятиям,
- подготовка к текущему контролю.

В части обеспечения освоения дисциплины обучающимся предоставляется раздаточный материал по темам дисциплины.

Процедура оценивания знаний, умений и навыков, обеспечивающих формирование компетенций, предусмотренных освоением дисциплины, включает:

- проведение тестирования на основе тестов, включающих теоретические вопросы и расчетные примеры;
- проведение опроса по ключевым вопросам, охватывающему содержание дисциплины.

6. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", включая перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

6.1. Основная:

1. Энциклопедия финансового риск-менеджмента. Под ред. А.А. Лобанова, Д.В. Чугунова. -2-е изд. – М.: Альпина Бизнес Букс, 2006
2. Дамодаран А. Стратегический риск-менеджмент: принципы и методики. Пер. с англ. - М.: ООО И.Д. Вильямс, 2010
3. Prakash A.S. Integrating Corporate Risk Management. Texere. 2001
4. Бартон Т., Шенкир У., Уокер П. Комплексный подход к риск-менеджменту: стоит ли этим заниматься. Пер. с англ. – М.: «Вильямс», 2003
5. Брейли Р., Майерс С. Принципы корпоративных финансов. Пер. с англ. 2-е изд. – М.: «Олимп-Бизнес», 2006
6. Бернштейн П. Против богов. Укрощение риска. – М.: «Олимп-Бизнес», 2000
7. Коупленд Т., Колер Т., Мурин Дж. Стоимость компании: оценка и управление. 3-е изд. Пер. с англ. – М.: «Олимп-Бизнес», 2005
8. Маккарти М.Т., Флинн Т.П. Риск: управление риском на уровне топ-менеджеров и совета директоров. Пер. с англ. – М.: Альпина Бизнес Букс, 2005
9. Найт Ф.Х. Риск, неопределенность и прибыль. Пер. с англ. – М.: Дело, 2003
10. Пайк Р., Нил Б. Корпоративные финансы и инвестирование. – 4-е изд. Пер. с англ. – СПб.: Питер, 2006
11. Райс Т., Койли Б. Финансовые инвестиции и риск. Пер. с англ. – Киев: BHV, 1995
12. Холмс Э. Риск-менеджмент. Пер. с англ. – М.: Эксмо, 2007
13. Stephen G.T. Risk Management – A practical Guide. Risk Metrics Group, 1999
14. Meulbrock L. Integrate Risk Management for the firm: A Senior Manager's Guide// Harvard Business School, 2002
15. Conny M., Dan G. Risk management. McGraw-Hill, 2001
16. Companies on risk: the benefits of alignment, Erust & Young, 2006
17. Risk Metrics. Corporate Metrics Technical Document. New York: Risk Metrics Group, 1999

6.2. Дополнительная литература.

1. Кельтон В., Лоу А. Имитационное моделирование. Классика CS. 3-е изд. – СПб.: Питер BHV, 2004
2. Марковиц Г., Шарп У. Инвестиционный портфель и фондовый рынок. – М.: Дело, 2001
3. Модильяни Ф., Миллер Ф. Сколько стоит форма. Теорема MCM. Пер. с англ. – 2-е изд. – М.: Дело, 2001
4. Шоломицкий А.Г. Теория риска. Выбор при неопределенности и моделировании риска. – М.: ГУ-ВШЭ, 2005
5. Barnett J., Meulbrock L., Honeywell I. End Integrated Risk Management. – HBS, Boston, 2000
6. Brown G., Chew D. Corporate Risk: Strategies and Management. – London, Risk Books, 1999
7. Culp C.L. The process of risk management – N.Y.: John Wiley & Sons, Inc. 2001
8. DeLoach J.W. Enterprise – Wide Risk Management: Strategies for linking Risk and opportunity. London: Financial Times, 2000
9. Dickson G. Corporate Risk Management. – London. Witherby & Co. Ltd., 1995
10. Nocco B.W., Stulz R.M. Enterprise Risk Management: Theory and Practice. Journal of Applied Corporate Finance, 2006

11. Lam J. Enterprise – wide risk management and the role of the chief risk officer. E-risk, 25. 2000
12. Stein J., Usher S., Labatutta D., Youngen J. A comparables approach to measuring cashflow-at-risk for nonfinancial firms. Journal of Applied Corporate Finance. Vol. 13 aug №4, 2001

6.3. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы.

Курасов В.В. Рабочая программа дисциплины (модуля) Б1.В.ДВ.1.2 «Стратегическая система управления рисками». Направление подготовки (специальность) 38.04.02 «Менеджмент». «Риск - менеджмент и страховой бизнес». – М., РАНХ и ГС, 2017.

6.4. Нормативные правовые документы.

1. Гражданский кодекс Российской Федерации.
2. Налоговый кодекс Российской Федерации. Части I и II.
3. Федеральный закон «О несостоятельности (банкротстве)» от 26.10.2002 № 127-ФЗ.
4. Федеральный закон «Об акционерных обществах» от 26.12.1995 г., № 208-ФЗ (с последующими изменениями и дополнениями).
5. Федеральный закон «Об инвестиционной деятельности в Российской Федерации, осуществляемой в форме капитальных вложений» от 25.02.1999 г., № 39-ФЗ (с последующими изменениями и дополнениями).
6. Федеральный закон «О консолидированной финансовой отчетности» от 27.07.2010 № 208-ФЗ.
7. Методические рекомендации по реформе предприятий (организаций). Министерство экономики Российской Федерации. Приказ от 01.10.1997 г., № 118.
8. Правила проведения арбитражным управляющим финансового анализа. Утверждено постановлением Правительства Российской Федерации от 25.06. 2003 г., № 367.
9. Положение по бухгалтерскому учету «Доходы организации», ПБУ 9/99. Министерство финансов Российской Федерации. Приказ от 06.05.1999 г.
10. Положение по бухгалтерскому учету «Расходы организации», ПБУ 10/99. Министерство финансов Российской Федерации. Приказ от 06.05.1999 г.

6.5. Интернет-ресурсы.

1. Сервер органов государственной власти Российской Федерации. – www.gov.ru
2. Официальный сайт Президента Российской Федерации. – president.kremlin.ru
3. Официальный сайт Правительства Российской Федерации. – www.government.gov.ru
4. Официальный сайт Счетной палаты Российской Федерации. – www.ach.gov.ru.
5. Официальный сайт Министерства финансов Российской Федерации. – www.minfin.ru
6. Официальный сайт Федеральной налоговой службы. – www.nalog.ru.
7. Официальный сайт Федеральной таможенной службы. – www.customs.ru.
8. – Официальный сайт Минэкономразвития РФ. www.economy.gov.ru
9. Сайт Росбизнесконсалтинг www.rbc.ru
10. Официальный сайт Центрального банка Российской Федерации. – www.cbr.ru.
11. Официальный сайт Пенсионного фонда Российской Федерации. – www.pfrf.ru.
12. Официальный сайт Фонда социального страхования Российской Федерации. – www.fss.ru.
13. Официальный сайт Федерального фонда обязательного медицинского страхования. – www.ffoms.ru.
14. Сервер группы Всемирного банка <http://www.worldbank.org.ru>
15. Сервер Международного валютного фонда <http://www.imf.org>

16. <http://www.coso.org/publications.htm>
17. <http://www.ferma-asso.org>
18. <http://www.rmmag.com>
19. <http://www.garp.com>
20. <http://www.irmi.com>
21. <http://www.finrisk.ru>
22. <http://www.library.ankil.ru>
23. <http://www.finpress.ru>
24. <http://www.rrms.ru>
25. <http://www.rbk.ru>
26. <http://www.intalev.ru>

6.6. Иные источники.

1. Методика CreditRisk+ в классическом варианте, разработанном аналитиками банка КредитСвисс. http://www.creditrisk.ru/publications/files_attached/creditrisk.pdf
2. CreditMetrics™ -- Technical Document. Greg M. Gupton, Christopher C. Finger, Mickey Bhatia. http://www.creditrisk.ru/publications/files_attached/creditmetrics_techdoc.pdf
3. RiskCalc™ For Private Companies: Moody's Default Model. Rating Methodology. Eric Falkenstein. http://www.creditrisk.ru/publications/files_attached/Moodys_Default_Model.pdf
4. Modeling Default Risk. Peter J. Crosbie, Jeffrey R. Bohn. http://www.creditrisk.ru/publications/files_attached/modeling_default_risk.pdf
5. A model of Bancruptcy Prediction. Eivind Bernhardsen. http://www.creditrisk.ru/publications/files_attached/norgesmod.pdf
6. CreditGrades™ Technical Document, May 2002. Christopher C. Finger.

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

7.1. Список учебно-лабораторного оборудования:

- персональный компьютер с выходом в Интернет;
- мультимедийный проектор.

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/>.

7.2. Программные, технические и электронные средства обучения и контроля знаний слушателей:

Microsoft Excel.