

**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 «22» мая 2018 г.
№ 6

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.ДВ.08.01 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 - 2018

Москва, 2018 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
 - 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

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

1.1. Дисциплина Б1.В.ДВ.08.01 «Управление рисками» обеспечивает овладение следующими компетенциями с учетом этапа:

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
ПК ОС-12	способность оценивать конкурентную среду и разрабатывать маркетинговую стратегию предприятия	ПК ОС-12.2	способность разрабатывать маркетинговую стратегию предприятия в профессиональной деятельности

1.2. В результате освоения дисциплины Б1.В.ДВ.08.01 «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 ОС-12.2	<p>На уровне знаний:</p> <p>Принципы целеполагания, основы организационного планирования и прогнозирования</p> <p>Национальные и международные документы, стандарты, лучшие практики по построению систем управления рисками</p> <p>Законодательство Российской Федерации и отраслевые стандарты по управлению рисками</p> <p>Корпоративные нормативные акты по управлению рисками в организации</p> <p>Отраслевые стандарты по управлению рисками</p> <p>Внутренний и внешний контекст функционирования организации</p> <p>Основы теории управления изменениями</p> <p>Принципы построения систем управления рисками</p> <p>Компоненты 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>На уровне умений:</p>

		<p> 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 сторонами по вопросам управления рисками </p> <p> На уровне навыков: 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 </p>
--	--	--

		<p>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/04.7</p> <p>Разработка системы управления рисками</p>	ПК ОС-12.2	<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</p>

		<p>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, 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 ОС-12.2	<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</p>

		<p>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 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</p>
--	--	---

		<p>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 ОС-12.2	<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 риска</p> <p>Процесс управления в чрезвычайных и кризисных ситуациях, а также управление непрерывностью бизнеса</p> <p>Законодательство Российской Федерации и отраслевые стандарты по управлению рисками</p> <p>Национальные и международные акты, стандарты, лучшие практики по построению систем управления рисками</p> <p>Стратегии, методы управления рисками и варианты их применения</p> <p>Принципы построения карты рисков, ее назначение и анализ</p> <p>Корпоративные нормативные акты по управлению рисками в организации</p> <p>Оценка эффективности воздействия на риск: выбор варианта или метода воздействия на риск, подготовка и внедрение планов воздействия на риск</p> <p>Современные информационные системы и технологии управления рисками и возможности их применения</p> <p>На уровне умений:</p> <p>Определять перечень мероприятий, достаточных для покрытия риска</p> <p>Анализировать и применять методики оценки и управления рисками</p> <p>Анализировать отчетность по всем видам</p>

		<p>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 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</p>
--	--	--

		Выработка рекомендаций по дальнейшему развитию системы управления рисками
Профессиональный стандарт Специалист по управлению рисками утв. 07.09.2015 № 591 В/07.7 Поддержание устойчивого функционирования системы управления рисками	ПК ОС-12.2	<p>На уровне знаний:</p> Национальные и международные акты, лучшие практики по стандартам социальной отчетности и регулированию вопросов устойчивого развития Основы устойчивого развития организации и социальной ответственности Национальные и международные акты, лучшие практики интегрированного управления рисками Мониторинг и оценка качества риск-менеджмента на основе системы индикаторов и их динамики Способы оценки эффективности процесса управления рисками Методы и процедуры совершенствования системы управления рисками
		<p>На уровне умений:</p> Анализировать актуальные данные по системе управления рисками, лучшие практики по построению системы управления рисками в России и мире, тренды риск-менеджмента Периодически анализировать корпоративную нормативную документацию по управлению рисками и вырабатывать рекомендации по пересмотру, актуализировать документацию Совершенствовать систему и процесс управления рисками в организации с учетом отраслевых стандартов Обрабатывать информацию по рискам в отрасли и в организации Составлять отчеты и использовать информацию, полученную из внутренних и внешних отчетов организации, а также из результатов аудиторских заключений
		<p>На уровне навыков:</p> Адаптация и актуализация системы управления

		<p>рисками под изменения бизнес-среды</p> <p>Обеспечение соответствия системы управления рисками внешним требованиям и лучшим практикам</p> <p>Организация и проведение внеплановых проверок готовности организации к чрезвычайным и кризисным ситуациям</p> <p>Подготовка материалов по уровню рисков и работе с рисками в разрезе отдельных нововведений для отчета перед вышестоящим руководством, собственниками</p>
<p>Профессиональный стандарт «Специалист по финансовому консультированию» утв. 19.03.2015 № 167н</p> <p>В/01.7</p> <p>Финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг</p>	ПК ОС-12.2	<p>На уровне знаний:</p> <p>Необходимый спектр финансовых продуктов и услуг</p> <p>Экономические и юридические аспекты инвестиционной деятельности</p> <p>На уровне умений:</p> <p>Собирать, анализировать и предоставлять достоверную информацию в масштабах всего спектра финансовых (инвестиционных) услуг</p> <p>Выступать в качестве эксперта в процессе принятия клиентом важных финансовых (инвестиционных) решений</p> <p>Рассчитывать стоимость финансовых решений, оценивая потенциальные риски</p> <p>Осуществлять профессиональные консультации, гарантирующие понимание всех преимуществ, возможностей и рисков</p> <p>На уровне навыков:</p> <p>Предоставление потребителю финансовых услуг информации о состоянии и перспективах рынка, тенденциях в изменении курсов ценных бумаг, иностранной валюты, условий по банковским продуктам и услугам</p> <p>Разъяснение сути финансовых продуктов, юридических и экономических характеристик финансовых продуктов и услуг</p> <p>Предоставление достоверной информации по контрагентам, условиям, требованиям к контрагенту, предмету сделки</p> <p>Разъяснение клиенту экономических и правовых последствий финансовых решений</p>

Профессиональный стандарт «Специалист по финансовому консультированию» утв. 19.03.2015 № 167н В/02.7 Разработка финансового плана для клиента и целевого инвестиционного портфеля	ПК ОС-12.2	<p>На уровне знаний:</p> Принципы формирования стоимости денег во времени Принципы дисконтирования денежного потока Принципы начисления сложных процентов Принципы расчета приведенной и будущей стоимости Принципы расчета доходности активов Методы дисконтирования денежных потоков, методы многовариантности расчетов, методы математического моделирования и количественной оптимизации Отечественные и международные стандарты в области финансового планирования Методика финансового анализа состояния клиента Принципы портфельного управления инвестированием Принципы подбора и распределения активов Принципы соотношения риска и доходности Понятия безрискового актива Способы управления финансовыми рисками <p>На уровне умений:</p> Получать, интерпретировать и документировать результаты исследований Использовать расчетные таблицы и калькуляторы Оценивать затраты на проведение финансовых операций Рассчитывать величину портфеля, достаточную для покрытия финансовых целей Выявлять соответствие/несоответствие инвестиционного профиля клиента параметрам инвестиционного портфеля <p>На уровне навыков:</p> Составление перечня рекомендаций по управлению инвестиционным риском

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

2. Объем и место дисциплины в структуре ОП ВО

Общая трудоемкость дисциплины Б1.В.ДВ.08.01 «Управление рисками» по учебному плану составляет 2 зачетных единицы; 72 академических часа, 3-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.08.01 «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 3-м семестре. По дисциплине осуществляется текущий контроль и промежуточный контроль в форме зачета.

Успешная реализация цели и задач дисциплины Б1.В.ДВ.08.01 «Управление рисками» достигается посредством получения обучающимися знаний, умений и навыков при изучении дисциплин базовой части Б1.Б.01 «Современный менеджмент» (1-й семестр), Б1.Б.02 «Методы исследования в менеджменте» (1-й семестр), Б1.В.09 «Экономика и управление организацией» (1-й семестр).

Знания, полученные в процессе изучения дисциплины, служат основой для освоения дисциплин Б1.В.03 «Инвестиционный менеджмент» (3-й семестр), Б1.В.06 «Стратегия развития предприятия» (3-й семестр).

Объем дисциплины

[illegible]

работа обучающихся (КСР)														
Самостоятельная работа обучающихся (СР)		54			54									
Промежуточная аттестация	форма	зачет												
	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.						С Р	Форма текущего контроля успеваемости ⁴ , промежуточной аттестации
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий						
			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 (ERM/IC))	26	2		4		20	ПЗ	
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/КОСО 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.08.01 «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.08.01 «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/KOSO 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 построьте 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 ОС-12	способность оценивать конкурентную среду и разрабатывать маркетинговую стратегию предприятия	ПК ОС-12.2	способность разрабатывать маркетинговую стратегию предприятия в профессиональной деятельности

Этап освоения компетенции	Показатель оценивания	Критерий оценивания
ПК ОС-12.2 способность разрабатывать маркетинговую стратегию предприятия в профессиональной деятельности	Анализирует факторы и условия выбора маркетинговой стратегии в своей профессиональной деятельности Выявляет проблемы успешной реализации маркетинговой стратегии Изучает возможности системы сбалансированных показателей как инструмента реализации маркетинговой стратегии компании Проводит стратегический анализ и разрабатывает маркетинговую стратегию компании с учетом влияния корпоративной культуры и организационной структуры	Компетентно анализирует факторы и условия выбора маркетинговой стратегии в своей профессиональной деятельности Самостоятельно выявляет проблемы успешной реализации маркетинговой стратегии Адекватно использует возможности системы сбалансированных показателей как инструмента реализации маркетинговой стратегии компании Самостоятельно проводит стратегический анализ и готов к разработке маркетинговой стратегии компании с учетом

	<p>на стратегический процесс</p> <p>Выбирает аналитический инструментарий для оценки конкурентной среды и выявляет граничные условия применения аналитических инструментов</p> <p>Использует современные методы управления проектом, направленные на своевременное получение качественных результатов, определение рисков, эффективное управление ресурсами</p> <p>Готов к реализации проекта с использованием современных инновационных технологий</p>	<p>влияния корпоративной культуры и организационной структуры на стратегический процесс</p> <p>Выбирает адекватный стратегическим задачам аналитический инструментарий для оценки конкурентной среды и самостоятельно выявляет граничные условия применения аналитических инструментов</p> <p>Корректно использует современные методы управления проектом, направленные на своевременное получение качественных результатов, определение рисков, эффективное управление ресурсами</p> <p>Готов к самостоятельной реализации проекта с использованием современных инновационных технологий</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 ОС-12.2) в процессе освоения образовательной программы.

Вопросы к зачету по дисциплине Б1.В.ДВ.08.01 «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.)

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-12.2.

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 60 баллов.

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 записывать 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 интернет-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:

Итоговый контроль – зачет. К экзамену необходимо готовиться целенаправленно, регулярно, систематически и с первых дней обучения по данной дисциплине. В самом начале учебного курса обучающимся необходимо ознакомиться со следующей учебно-методической документацией:

- программой дисциплины;
- перечнем знаний и умений, которыми студент должен владеть;
- тематическими планами лекций, семинарских занятий;
- контрольными мероприятиями;
- учебником, учебными пособиями по дисциплине, а также электронными ресурсами;
- перечнем вопросов к экзамену.

После этого у обучаемого должно сформироваться четкое представление об объеме и характере знаний и умений, которыми надо будет овладеть по дисциплине. Систематическое выполнение учебной работы на лекциях и семинарских занятиях позволит успешно освоить дисциплину и создать хорошую базу для сдачи зачета.

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/

Алексеев 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 СУР, документ COSO, Разработка ключевых индикаторов риска для укрепления СУР (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 ЮРАЙТ. 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/>.