

**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 Управление фирмой

Протокол от «02» сентября 2019 г.

№ 9

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 - 2020

Москва, 2019 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 стратегическому и тактическому планированию и организации производства» утв. 08.09.2014 г. № 609н В/03.7 Стратегическое управление процессами конструкторской, технологической и организационной подготовки производства	ПК ОС-12.2	на уровне знаний: Основные принципы построения экономической системы организации Принципы и методы управления основными и оборотными средствами, методы оценки эффективности их использования Организация производственного и технологического процессов Состав материальных, трудовых и финансовых ресурсов организации, показатели их эффективного использования; Основные технико-экономические показатели деятельности организации и методика их расчета Принципы и методы построения системы и инструменты управления производством с помощью современной логистики Основы планирования жизненного цикла инновационной машиностроительной продукции Основы современного материального производства

		<p>Методы оценки качества и конкурентоспособности наукоемкой продукции</p> <p>на уровне умений: Рассчитывать по принятой методологии основные технико-экономические показатели деятельности организации Разрабатывать и применять на практике модели управления производственными ресурсами и логистическими цепочками Разрабатывать экономико-математические и компьютерные модели производственно-коммерческих процессов жизненного цикла наукоемкой продукции Организовывать проектную работу в организации, разрабатывать и контролировать ресурсно-временные проектные показатели</p> <p>на уровне навыков: Самостоятельная оценка экономических явлений, уровня и динамики изменения экономических показателей с позиции рационализации хозяйственной деятельности предприятия в сфере профессиональной деятельности Определение технической политики и направлений технического развития организации в условиях рыночной экономики, путей реконструкции и технического перевооружения действующего производства, уровня специализации и диверсификации производства на перспективу, организация и планирование мероприятий по разработке, освоению и внедрению в производство экономически эффективных новых изделий заданного уровня качества при установленных сроках, объемах выпуска и затратах Проведение на уровне промышленной организации стратегических мероприятий, направленных на обеспечение технологичности конструкции изделий, эффективное освоение технологических процессов и средств технологического оснащения Управление процессами организационной подготовки производства в промышленной организации, осуществление компьютерного моделирования процессов перехода на выпуск нового изделия, проведение организационно-плановых расчетов циклов, величины партии,</p>
--	--	---

		<p>заделов и других показателей с целью соблюдения принципов специализации, параллельности, непрерывности, пропорциональности, прямоотчности, автоматичности и ритмичности</p> <p>Руководство комплексом работ по конструкторской, технологической и организационной подготовке производства на уровне промышленной организации, координация и направление совместной деятельности работников, согласование наиболее сложных вопросов, относящихся к подготовке производства, с другими подразделениями организации, проектными, исследовательскими организациями, представителями заказчиков</p> <p>Обеспечение необходимого уровня подготовки производства и его постоянный рост, повышение эффективности производства и производительности труда, сокращение издержек (материальных, финансовых, трудовых), рациональное использование производственных ресурсов, высокое качество и конкурентоспособность производимой продукции, работ или услуг, соответствие выпускаемых изделий действующим государственным стандартам, техническим условиям и требованиям технической эстетики, а также их надежность и долговечность</p> <p>Организация разработки и внедрения в производство прогрессивных, экономически обоснованных, ресурсосберегающих технологических процессов, обеспечивающих высокий уровень технологической подготовки производства, производительности труда, качества выпускаемой промышленной продукции на уровне лучших отечественных и зарубежных образцов</p> <p>Контроль выполнения перспективных и текущих планов конструкторской, технологической и организационной подготовки производства, обеспечение строгого соблюдения установленных технологических процессов, выявление нарушений технологической дисциплины и проблемных ситуаций организационно-управленческого характера, принятие мер по их упреждающему устранению</p>
--	--	---

<p>Профессиональный стандарт «Специалист по стратегическому и тактическому планированию и организации производства» утв. 08.09.2014 г. № 609н</p> <p>В/01.7 Стратегическое управление процессами планирования производственных ресурсов и производственных мощностей</p>	<p>ПК ОС-12.2</p>	<p>на уровне знаний: Основы экономики организации и правового регулирования ее деятельности Принципы и закономерности функционирования организации в современных социально-экономических условиях Содержание основных процессов в организации Методологические основы проведения логистикоориентированного анализа системы и среды ее функционирования Методы моделирования технологий обеспечения качества, методы классификации, методы принятия решений в условиях неопределенности и риска Базовые идеи, подходы, методы и результаты прикладной статистики, экспертных оценок, теории принятия решений и экономико-математического моделирования</p> <p>на уровне умений: Использовать нормативные правовые акты в своей профессиональной деятельности Анализировать социально-экономические проблемы и процессы в организации Находить организационно-управленческие и экономические решения проблем организации Использовать законы естественно-научных дисциплин в профессиональной деятельности и применять математический аппарат, методы оптимизации, теории вероятностей, математической статистики, системного анализа для принятия решений в области стратегического и тактического планирования и организации производства Проводить комплексное изучение отраслевого рынка промышленной продукции, потребителей товаров, поставщиков сырья, материалов и комплектующих, конкурирующих организаций-производителей продуктов-заменителей, оценивать уровень конкурентной борьбы, составлять обзоры конъюнктуры рынка Разрабатывать методы и модели создания системы управления процессами планирования производственных ресурсов и производственных мощностей промышленной организации</p> <p>на уровне навыков:</p>
--	-------------------	---

		<p>Использование нормативных правовых актов в своей профессиональной деятельности</p> <p>Анализ социально-экономических проблем и процессов в организации</p> <p>Разработка и реализация организационно-управленческих и экономических решений</p> <p>Руководство разработкой основных положений продуктовой и технологической стратегии развития организации, определение основных параметров производственно-технологической и инновационной политики организации с целью минимизации издержек производства, приведения качества продукции в соответствие с запросами потребителей</p> <p>Организация работы по формированию иерархии прогнозов производственных процессов на стратегическом и тактическом горизонтах принятия управленческих решений с целью определения потребностей рынках в новой и модернизированной продукции, потребностей организации в производственных ресурсах и производственных мощностях</p> <p>Стратегическое управление длительными и ресурсоемкими комплексами работ на основе проектно- и программно-ориентированного планирования деятельности организации, бюджетирования и мониторинга хода выполнения проектов и программ</p> <p>Клиентоориентированное стратегическое и тактическое управление конфигурациями промышленной продукции и технологическими маршрутами ее производства в организации на основе долгосрочных и среднесрочных прогнозов развития рынка</p> <p>Обеспечение ритмичной работы организации и равномерного выпуска продукции, выполнения работ в соответствии с производственными программами, договорными обязательствами, календарными графиками и сменно-суточными заданиями</p> <p>Организация работы и эффективного взаимодействия всех структурных подразделений, цехов и производственных единиц промышленной организации</p>
--	--	--

		<p>Организация производственно-хозяйственной деятельности на основе широкого использования новейшей техники и технологии, прогрессивных форм управления и организации труда</p> <p>Обеспечение организации квалифицированными кадрами, рациональное использование и развитие их профессиональных знаний и опыта, создание безопасных и благоприятных для жизни и здоровья условий труда, соблюдение требований законодательства об охране окружающей среды</p> <p>Обеспечение правильного сочетания экономических и административных методов руководства, единоначалия и коллегиальности</p> <p>Руководство подведением итогов работы и оценкой деятельности подразделений организации по выполнению производственных программ выпуска продукции</p> <p>Участие в разработке и реализации мероприятий по совершенствованию производственного планирования, внедрению технических и программных средств управления производством</p> <p>Регулярный контроль за ходом производства и других видов основной деятельности организации, принятие мер по предупреждению и устранению проблемных ситуаций в производственных процессах</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

на уровне знаний:

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

Методы количественного и качественного анализа финансовых показателей

Порядок и принципы составления финансовых планов

Методики и инструментарий финансового планирования

Методики инвестиционного профилирования клиентов (риск-профилирование)

на уровне умений:

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

Рассчитывать размер инвестиций, необходимый для достижения целей клиента

Рассчитывать целевую доходность в зависимости от финансовых целей и начального капитала

Определять порядок проведения финансовых операций в зависимости от вида финансовых продуктов

на уровне навыков:

Составление перечня рекомендаций по управлению инвестиционным риском

Составление инвестиционного портфеля

Выявление качественных и количественных свойств рисков в предполагаемых к использованию финансовых продуктах

Привлечение к решению задач финансового планирования независимых внешних консультантов и экспертов в области финансовых рынков

Согласование условий инвестиционного портфеля с клиентом

Регулярный пересмотр качества инвестиционного портфеля клиента (селекция и аллокация активов)

Проведение расчетов величины портфеля, достаточной для покрытия финансовых целей

Расчет размера инвестиций, необходимого для достижения целей клиента
 Расчет целевой доходности в зависимости от финансовых целей и начального капитала
 Анализ финансового положения клиента
 Выявление несоответствий текущего финансового состояния клиента его финансовым целям
 Подбор классов активов и финансовых продуктов в соответствии с потребностями клиента
 Проведение стресс-тестов и сценарного анализа
 Моделирование целевого портфеля клиента
 Расчет параметров целевого инвестиционного портфеля
 Формирование финансового плана и критериев мониторинга его выполнения
 Определение и согласование правил информирования клиента
 Установление критериев оценки показателей инвестиционного портфеля
 Пересмотр (ребалансировка) состава активов клиентского портфеля
 Мониторинг финансового плана, определение критериев эффективности финансового плана и качества инвестиционного портфеля клиента
 Анализ изменения стоимости капитала инвестиционного портфеля
 Составление прогноза денежного потока
 Оптимизация финансового плана
 Анализ использования заемных средств (кредитные продукты)
 Моделирование целевого портфеля
 Презентация согласованных финансовых решений клиенту
 Определение критериев взаимодействия с клиентом

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 исследований 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

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.					С Р	Форма текущего контроля успеваем ости ⁴ , промежут очной аттестаци и
		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/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.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/KOCO 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/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 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 61 баллов.

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

№ п/п	Российская система	Баллы	Оценка ECTS	Словесная интерпретация оценок ECTS
1	Зачтено	96-100	A	Excellent – выдающиеся знания с возможными незначительными погрешностями
2		91-95	B	Very Good – знания выше среднего уровня, с некоторыми ошибками
3	Зачтено	81-90	C	Good – правильно выполненная работа с несколькими заметными ошибками
4		71-80	D	Satisfactory – работа, выполненная удовлетворительно, с заметными недостатками
5	Зачтено	61-70	E	Sufficient – знания, удовлетворяющие минимальным критериям
6	Зачтено	61 и более	P	Passed – знания, удовлетворяющие оценочным требованиям

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:

Итоговый контроль – зачет. К экзамену необходимо готовится 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/ 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 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/>.