

## **АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ**

### **Б1.В.19 Управление рисками в организации (Organisational Risk Management)**

**Авторы:** Цакаев А.Х., профессор кафедры экономики и финансов

Олькова А.Е., старший преподаватель кафедры экономики и финансов

**Код и наименование направления подготовки, профиля:** 38.03.02 Менеджмент  
(Корпоративное управление)

**Квалификация (степень) выпускника:** бакалавр

**Форма обучения:** очная

#### **Цель освоения дисциплины:**

Сформировать компетенции в области анализа рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании, в области участия в формировании стратегии компании с учетом корпоративной структуры, в области использования современных управленческих концепций (теория ограничений систем, 6 SIGM, Lean Management, Кайдзен и другие) в управлении операционной деятельностью корпорации

#### **План курса:**

**Тема 1.** Цели и содержание риск-менеджмента в рамках корпоративного управления.

Стандарты по риск-менеджменту

Цели, структура и содержание стандартов по управлению рисками: ISO 31000:2009, COSO ERM, FERMA. Терминология, используемая в стандартах. Подходы к определению понятий «неопределенность» и «риск». Понятие события, возможности и риска по стандарту COSO ERM. Подходы к определению понятия риск-менеджмента. Содержание риск-менеджмента с точки зрения процессного подхода.

## **Тема 2.** Определение условий риск-менеджмента организации

Понятие среды по стандарту ISO/IEC 73:2009. Внешняя среда, внутренняя среда, среда риск-менеджмента. Структурирование внешней среды. Внешняя среда как совокупность факторов прямого и косвенного воздействия. Внешняя среда как совокупность возможностей и угроз. Типология условий внешней среды. Анализ макроокружения организации. PEST (PESTLE, STEEPLED) анализ. Особенности оценки факторов внешней среды. Анализ микроокружения организации. Метод пяти сил Портера. Анализ внутренней среды. Компоненты внутренней среды: цель, технология, структура, задачи, персонал, результат. Матрица BCG. Анализ факторов риска со стороны внутренней среды. Финансовый анализ. Совместный анализ внешней и внутренней среды. SWOT и SPACE-анализ. Оценка стратегического потенциала фирмы.

## **Тема 3.** Идентификация рисков компании

Идентификация рисков как основной элемент системы оценки рисков. Необходимая информация для идентификации рисков. Правила идентификации и описания рисков. Методы идентификации рисков: контрольные листы, РНА, мозговой штурм, метод Дельфи, структурированные интервью. Идентификация рисков на различных уровнях (компании, подразделения, бизнес-процесса, проекта). Типовые риски холдингов, направлений бизнеса, бизнес-процессов. Группировка и агрегирование рисков. Формирование итогового реестра рисков.

## **Тема 4.** Оценка рисков в корпоративном управлении

Содержание процесса оценки рисков в соответствии с международными стандартами. Оценка вероятности, оценка последствий, оценка присущего риска, оценка остаточного риска, оценка средств управления рисками. Подходы к оценке риска: количественный, полуколичественный, качественный. Методы оценки риска: наблюдение, организационные (вспомогательные) методы, анализ сценариев, анализ функциональности, статистические методы, анализ средств управления рисками. Визуализация рисков. Диаграмма «рыбий скелет», дерево отказов и дерево событий, диаграмма «галстук-бабочка», диаграмма «торнадо», диаграмма Spider, матрица и карта рисков. Сравнительный анализ рисков. Определение риск-аппетита и толерантности к риску.

## **Тема 5.** Методы управления рисками

Процесс воздействия на риск организации. Избежание (уклонение) риска: продажа активов, отказ от проекта, уход с рынка. Передача риска: страхование, хеджирование, партнерские отношения. Минимизация риска: минимизация последствий и минимизация вероятности наступления. Принятие риска: создание резервов и мониторинг.

**Тема 6. Составление отчетности о рисках**

Информация о рисках, необходимая стейкхолдерам. Содержание и структура отчета о рисках. Влияние рисков на организационные цели: методика RiskScorecard. Визуализация рисков. Оценка эффективности мер воздействия на риски.

**Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:**

| Код компетенции | Наименование компетенции  | Код этапа освоения компетенции | Наименование этапа освоения компетенции  |
|-----------------|---|--------------------------------|--|
| ПК-15           | Умение анализа рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании                                 | ПК-15.1                        | Способность анализировать рыночные и специфические риски для принятия управленческих решений |
| ПК ОС-22-б      | Способность участвовать в формировании стратегии компании с учетом корпоративной структуры  | ПК ОС-22-б.2                   | Способность разрабатывать проект в условиях международной кооперации и интеграции            |
| ПК ОС-24-б      | Способность использовать современные управленческие концепции (теория ограничений систем, 6 SIGM, Lean Management, Кайдзен и другие) в управлении операционной деятельностью корпорации | ПК ОС-24-б.2                   | Способность принимать решения, учитывая инновационные изменения в компании                   |

| Код этапа освоения компетенции | Результаты обучения   |
|--------------------------------|---|
| ПК-15.1                        | <p>на уровне знаний:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• об анализе функциональности (FMEA, FMECA, HAZOP, НАССР)</li> <li>• об адаптации процесса управления рисками к требованиям законодательства</li> <li>• о проведении сценарного анализа</li> <li>• о проведении статистического анализа рисков</li> <li>• структуру внешней и внутренней среды организации</li> <li>• источники рисков организации</li> </ul> |
|                                | <p>на уровне умений:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• оценивать последствия и вероятность с помощью качественных методов</li> <li>• проводить сравнительный анализ риска</li> <li>• выбирать методы воздействия на риск</li> </ul>  |
|                                | <p>на уровне навыков:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• SPACE-анализа</li> <li>• финансового анализа</li> </ul>  |
| ПК ОС-22-6.2                   | <p>на уровне знаний:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• о проведении PEST (PESTLE, STEEPLED)-анализа</li> <li>• об анализе внутренней среды организации</li> <li>• о проведении SWOT-анализа</li> <li>• о составлении контрольных листов</li> </ul>   |
|                                | <p>на уровне умений:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• проводить анализ внешней и внутренней среды организации</li> <li>• идентифицировать и классифицировать риски организации</li> <li>• проводить вербальное описание рисков</li> </ul>   |
|                                | <p>на уровне навыков:</p>   |

|              |   |
|--------------|---|
|              | <ul style="list-style-type: none"> <li>• SPACE-анализа</li> <li>• финансового анализа</li> </ul>  |
| ПК ОС-24-6.2 | на уровне знаний: <ul style="list-style-type: none"> <li>• общее и особенное в содержании стандартов ISO, COSO и FERMA по управлению рисками</li> <li>• подходы к классификации рисков</li> <li>• перечень необходимой информации для анализа и оценки рисков</li> <li>• методы оценки риска (последствий и вероятности)</li> <li>• подходы к оценке различных типов рисков</li> <li>• информационные технологии, используемые в процессе управления рисками</li> </ul> |
|              | на уровне умений: <ul style="list-style-type: none"> <li>• применять лучшие практики в области управления рисками в повседневной управленческой деятельности</li> <li>• применять отраслевые нормативные акты в деятельности по риск-менеджменту</li> </ul>   |
|              | на уровне навыков: <ul style="list-style-type: none"> <li>• SPACE-анализа</li> <li>• финансового анализа</li> </ul>   |

В ходе реализации дисциплины используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

– при проведении занятий лекционного типа: опрос, практическое задание (в том числе с применением дистанционных образовательных технологий (ДОТ)).

Промежуточная аттестация проводится в форме: зачета (в форме письменного знаниевого теста с открытыми вопросами и выполнения практического задания)

### **Основная литература:**

1. Воронцовский А.В., Управление рисками: учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры, М.: Юрайт, 2018

2. Екимова К.В., Савельева И.П., Кардапольцев К.В., Финансовый менеджмент: учебник для прикладного бакалавриата, М.: Юрайт, 2019