

**Федеральное государственное образовательное бюджетное учреждение  
высшего образования  
«ФИНАНСОВЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПРИ ПРАВИТЕЛЬСТВЕ  
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»  
(Финансовый университет) Новороссийский  
филиал**



**Кафедра «Экономика, финансы и менеджмент»**

Зайковский Б.Б.

Управление рисками в корпорациях

**Рабочая программа дисциплины**

для студентов, обучающихся по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент профиль

«Корпоративное управление» (очное обучение)

*Рекомендовано Ученым советом Новороссийского филиала Финансового университета*

*протокол № 14 от 29 августа 2019 г.*

*Одобрено кафедрой «Экономика, финансы и менеджмент»*

*протокол № 1 от 28 августа 2019 г.*

**Зайковский Б.Б.** Управление рисками в корпорациях. Рабочая программа по направлению 38.03.02 «Менеджмент» профиль «Корпоративное управление», очная, заочная формы обучения - Новороссийск: Финансовый университет при Правительстве РФ, кафедра «Экономика, финансы и менеджмент», 2019. - 27 с.

Программа дисциплины «Управление рисками в корпорациях» предназначена для эффективной организации учебного процесса и включает содержание дисциплины, учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины, фонд оценочных средств для промежуточной аттестации, методические указания по освоению дисциплины, описание материально-технической базы.

## Содержание рабочей программы дисциплины

<b>1. Наименование дисциплины .....</b>	<b>3</b>
<b>2. Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы (перечень компетенций) с указанием индикаторов их достижения и планируемых результатов обучения по дисциплине.....</b>	<b>3</b>
<b>3. Место дисциплины в структуре образовательной программы .....</b>	<b>4</b>
<b>4. Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах и в академических часах с выделением объема аудиторной (лекции, семинары) и самостоятельной работы обучающихся .....</b>	<b>4</b>
<b>5. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) дисциплины с указанием их объемов (в академических часах) и видов учебных занятий.....</b>	<b>7</b>
5.1. Содержание дисциплины .....	7
5.2. Учебно-тематический план.....	4
5.3. Содержание семинаров, практических занятий.....	8
<b>6. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине.....</b>	<b>10</b>
6.1. Перечень вопросов, отводимых на самостоятельное освоение дисциплины, формы внеаудиторной самостоятельной работы .....	10
6.2. Перечень вопросов, заданий, тем для подготовки к текущему контролю .....	12
<b>7. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине.....</b>	<b>13</b>
<b>8. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины .....</b>	<b>21</b>
<b>9. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины .....</b>	<b>22</b>
<b>10. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины .....</b>	<b>.....</b>
<b>11. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень необходимого программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости) .....</b>	<b>24</b>
11.1 комплект лицензионного программного обеспечения .....	24
11.2 Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы: .....	24
11.3 Сертифицированные программные и аппаратные средства защиты информации .....	24
<b>12. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине .....</b>	<b>24</b>

## 1. Наименование дисциплины

Управление рисками в корпорациях

2. Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы (перечень компетенций) с указанием индикаторов их достижения и планируемых результатов обучения по дисциплине

### 3.

Дисциплина «Управление рисками в корпорациях» по направлению 38.03.02 «Менеджмент» профиль «Корпоративное управление» обеспечивает формирование следующих компетенций:

Код компетенции	Наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции <sup>1</sup>	Результаты обучения (владения, умения и знания), соотнесенные с компетенциями/индикаторами достижения компетенции
ПКН-11	Способность анализировать рыночные и специфические риски при решении задач управления организацией	1. Демонстрирует знания математических методов, применяемых в менеджменте.	<b>Знать:</b> основные математические методы и модели, применяемые при управлении рисками в корпорациях; <b>Уметь:</b> применять теоретические знания математических методов и интерпретировать полученные результаты для принятия решений риск - менеджмента;
		2. Применяет математические методы и модели для обоснования принятия управленческих решений.	<b>Знать:</b> методы и модели диагностики, оценки и расчета уровня риска; приемы и способы снижения рисков при принятии управленческих решений в компании <b>Уметь:</b> применять математические модели и методы риск - менеджмента для решения задач управления финансовыми и нефинансовыми рисками, управления инновационно - инвестиционными проектами корпораций.
		3. Содержательно интерпретирует результаты, полученные при использовании математических моделей.	<b>Знать:</b> инструменты и методы формирования моделей управления рисками в различных сферах деятельности и на различных стадиях жизненного цикла корпораций <b>Уметь:</b> интерпретировать и анализировать результаты, получаемые при моделировании и разработке сценариев управления рисками, анализировать вероятностные распределения полученных результатов

ПКП-3	Владение методами и навыками разработки и организации процедур контроля в системе корпоративного управления (ПКП-3)	1.Применяет современные методы анализа действующей практики разработки и организации процедур контроля в системе корпоративного управления	Знать: современные методы оценки анализа действующей практики разработки и организации процедур контроля в системе корпоративного управления Уметь: применять современные методы анализа действующей практики разработки и организации процедур контроля в системе корпоративного управления
		2.Определяет способы организации деятельности органов корпоративного контроля в компании	Знать: способы организации деятельности органов корпоративного контроля в компании Уметь: определять способы организации деятельности органов корпоративного контроля в компании
		3.Организует эффективное взаимодействие органов корпоративного контроля и корпоративного управления с целью повышения результативности их деятельности	Знать: современные методы организации эффективного взаимодействия органов корпоративного контроля и корпоративного управления. Уметь: организовывать эффективное взаимодействие органов корпоративного контроля и корпоративного управления
ПКП-4	Способность к организации деятельности с целью организации управления акционерной(корпоративной) собственностью	1.Применяет современные методы управления акционерной (корпоративной) собственностью	Знать: современные методы управления акционерной (корпоративной) собственностью Уметь: применять современные методы управления акционерной (корпоративной) собственностью
		2.Организует взаимодействие органов корпоративного управления с целью эффективного управления акционерной (корпоративной) собственностью	Знать: современные методы организации эффективного взаимодействия органов корпоративного управления.; Уметь: организовывать эффективное взаимодействие органов корпоративного управления
		3.Организует мониторинг оценки практики управления акционерной (корпоративной) собственностью	Знать: технологии мониторинга оценки практики управления акционерной (корпоративной) собственностью Уметь: организовывать мониторинг оценки практики управления акционерной (корпоративной) собственностью

### 3. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Управление рисками в корпорациях» относится к модулю дисциплин по выбору, углубляющих освоение профиля, образовательной программы по направлению подготовки 38.03.02 «Менеджмент», профиль «Менеджмент организации».

### 4. Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах и в академических часах с выделением объема аудиторной (лекции, семинары) и самостоятельной работы обучающихся

Очная форма обучения, 2018 год приема

Таблица 1

Вид учебной работы по дисциплине	Всего в з/е и часах	Семестр 6 (в часах)	Семестр 7 (в часах)
<b>Общая трудоёмкость дисциплины</b>	<b>6/216</b>	<b>108</b>	<b>108</b>
<i>Контактная работа - аудиторные</i>	100	50	50
<i>Лекции</i>	32	16	16
<i>Семинары, практические занятия</i>	68	34	34
<i>Самостоятельная работа</i>	116	58	58
Вид текущего контроля	Домашнее творческое задание	Домашнее творческое задание	
Вид промежуточной аттестации	Экзамен\зачет	зачет	экзамен

### 5. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) дисциплины с указанием их объемов (в академических часах) и видов учебных занятий

#### 5.1. Содержание дисциплины

##### Тема 1. Понятие и классификация рисков

Предмет и задачи курса. Понятие неопределенности, угроз и рисков. Виды неопределенности. Значение и влияние риска на деятельность корпорации

Историческое развитие взглядов ведущих экономистов на понятие риска. Основные концепции риска. Отношения и подходы к риску компании. Причины и источники возникновения рисков в корпорации. Объективная и субъективная стороны риска. Виды рисков. Классификация рисков месту возникновения, по уровню опасности, по субъектам

хозяйственной деятельности, по уровням жизненного цикла корпорации. Риски простые и сложные, функциональные риски. Систематический и несистематический риск.

Классификация финансовых рисков.

## **Тема 2. Диагностика рисков**

Методические аспекты диагностики рисков. Стандарты управления рисками. Методы и инструменты диагностики. Экспресс-диагностика. Прогноз- диагностика. Основные процедуры диагностики корпоративных рисков.

Классификация факторов риска. Методы (способы) идентификации рисков. Идентификатор рисков. Картографирование рисков. Сигнальные карты рисков. Карта индивидуального риска. Особенности диагностирования и картографирования рисков в российских корпорациях.

## **Тема 3. Методы анализа рисков. Расчет уровня риска**

Принципы анализа рисков. Идентификация возможных областей возникновения рисковых ситуаций. Метод аналогии в управлении риском. Метод балльной оценки риска. Определение списка факторов, определяющих степень риска проекта. Разработка состава показателей, характеризующих влияние на риск. Сбалансированная система показателей.

Качественный анализ рисков. Методы качественной оценки рисков. Количественный анализ рисков. Методы количественной оценки рисков. Оценка влияния каждого показателя по методу дерева решений в управлении риском. Метод Монте-Карло (статистических испытаний).

Методы экспертных оценок риска. Метод "Дельфи". Координация (согласование) мнений экспертов. Методы портфолио. Моделирование риска. Модели экономического анализа рисков.

Определение условий экономической безопасности и устойчивости корпорации, уровни риска. Ранжирование рисков, границы рисков, шкала границ риска. Зоны риска и кривая риска.

## **Тема 4. Критерии и методы оценки риска**

Оценка риска. Оценка полезности и меры риска. Качественная и количественная оценка риска и возможности их применения.

Обоснование критериальных показателей оценки риска, вероятность и достоверность оценки. Виды потерь и их источники. Варианты оценки потерь в зависимости от формы деятельности. Типичные и специфические риски в деятельности корпораций. Прямые и косвенные показатели оценки риска. Классификация методов оценки рисков.

## **Тема 5. Риск - менеджмент в корпорации**

Теория управления рисками. Цели и задачи управления рисками. Принципы управления рисками. Внешний и внутренний мониторинг рисков. Функции управления

рисками. Планирование в системе управления рисками. Основные этапы риск - менеджмента. Организация службы риск - менеджмента.

Приемы и способы снижения рисков. Уход от рисков, минимизация рисков, передача рисков, принятие рисков. Методы управления рисками в различных сферах деятельности и на различных стадиях жизненного цикла корпораций. Диверсификация, лимитирование, страхование и хеджирование. Виды страхования рисков: сострахование, двойное страхование, перестрахование, самострахование.

Методы передачи рисков, компенсация рискованных потерь, создание запасов и резервов на покрытие рисков.

### **Тема 6. Система управления финансовыми рисками корпорации**

Характеристика финансовых рисков и их место в системе рисков корпорации.

Классификация финансовых рисков по различным параметрам. Ценовые риски. Кредитные риски: прямой, риск дефолта по ценным бумагам, риск неисполнения обязательств, риски по производным финансовым инструментам, расчетный риск. Операционные риски. Налоговые риски. Инвестиционные риски. Управление рисками инновационно-инвестиционных проектов. Риск финансового мошенничества (fraudinvestigationrisk) в корреспонденции с нормами УК РФ.

Финансовое состояние корпорации и риск банкротства. Основные направления восстановления платежеспособности и снижения риска банкротства корпорации.

### **Тема 7. Нефинансовые риски корпорации**

Виды и классификация нефинансовых рисков: производственные, технико - технологические, информационные, правовые, кадровые, экологические, репутационные, политические, социальные и др. Риски корпоративного управления и государственного регулирования.

Технологии и стандарты управления нефинансовыми рисками. Нефинансовые риски корпорации при принятии инвестиционных решений. Риски текущей производственной деятельности. Риски технико - технологических преобразований и реформирования организационно - правовой структуры корпорации.

Оценка нефинансовых рисков. Включение нефинансовых рисков в общую систему управления рисками корпорации. особенности управления нефинансовыми рисками

## Тема 8. Управление рисками инновационно-инвестиционных проектов

Риск инновационно- инвестиционной деятельности. Источники неопределенности инвестиционной деятельности. Цикл управления рисками инновационно-инвестиционной деятельности. Задачи управления рисками в инновационно-инвестиционной деятельности.

Собственный риск проекта. Корпоративный, или внутрифирменный, риск.

Рыночный риск.

Метод корректировки нормы дисконта с учетом риска. Метод достоверных эквивалентов (коэффициентов определенности). Анализ чувствительности критериев эффективности. Метод сценариев (scenarioanalysis). Определение вариантов изменений ключевых исходных показателей (пессимистический, наиболее вероятный и оптимистический). Анализ вероятностных распределений полученных результатов.

### 5.2. Учебно-тематический план

Очная форма обучения, 2018 год приема

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Трудоемкость в часах						Формы текущего контроля успеваемости
		Всего	Аудиторная работа				Самостоятельная работа	
			Общая	Лекции	Практические и семинарские занятия	Занятия в интерактивных формах		
1.	Понятие и классификация рисков	25	12	4	8	4	13	опрос, решение тестовых заданий
2.	Диагностика рисков	24	12	4	8	4	12	опрос, решение кейсов и практических заданий
3.	Методы анализа рисков. Расчет уровня риска	27	12	4	8	4	15	опрос, решение тестовых и практических заданий
4.	Критерии и методы оценки риска	24	12	4	8	4	12	опрос, решение тестовых и практических заданий
5.	Риск - менеджмент в корпорации	23	13	4	8	4	11	опрос, решение тестовых, практических заданий

6.	Система управления финансовыми рисками корпорации	22	13	4	8	4	10	опрос, решение практических заданий
7.	Нефинансовые риски корпорации	29	13	4	8	4	17	опрос, решение тестовых и практических заданий
8.	Управление рисками инновационно-инвестиционных проектов	28	13	4	8	4	16	опрос, решение тестовых и практических заданий
В целом по дисциплине		216	100	32	68	32	116	Согласно учебному плану: расчетно-аналитическая работа
Итого в %						50%		

### 5.3. Содержание семинаров, практических занятий

Таблица 3

Наименование тем (разделов) дисциплины	Перечень вопросов для обсуждения на семинарских, практических занятиях, рекомендуемые источники из разделов 8,9 (указывается раздел и порядковый номер источника)	Формы проведения занятий
Понятие и классификация рисков	1. Понятие риска в научном и прикладном значениях. Понятие неопределенности, угроз и рисков 2. Классификация рисков по месту возникновения, по уровню опасности, по субъектам хозяйственной деятельности, по уровням жизненного цикла корпорации 3. Модели поведения и особенности управления риском в компании на разных этапах ее жизненного цикла. Предпринимательские и финансовые риски Рекомендуемая литература: 8.1; 8.2, 8.3	Опрос. Обсуждение дискуссионных вопросов. Сравнительный анализ отношения компаний к риску и подходы к управлению рисками в российской и зарубежной моделях корпоративного управления, решение тестовых заданий.
	4. Организационно-экономические и правовые аспекты возникновения рисков в корпоративных организациях, и их последствия Рекомендуемая литература: 8.1; 8.2, 8.3	

<p>Диагностика рисков</p>	<p>1. Методические аспекты диагностики рисков. Методы и инструменты диагностики 2. Классификация факторов риска. Управленческие инструменты и механизмы, обеспечивающие эффективную диагностику рисков.</p> <p>3. Методы диагностики рисков; Установление актуального рискового профиля</p> <p>4. Этапы диагностики рисков. Зоны риска. Понятие приемлемого риска. Картографирование рисков</p> <p>Рекомендуемая литература: 8.1; 8.2, 8.3</p>	<p>Опрос. Обсуждение дискуссионных вопросов. Решение тестовых заданий. Составление сравнительной таблицы, отражающей сравнительный анализ нормативно-правовых документов действующих публичных корпораций, входящих в Топ-100</p>
---------------------------	--	---

<p>Методы анализа рисков. Расчет уровня риска</p>	<p>1. Принципы анализа рисков. Количественные и качественные показатели и методы анализа рисков корпорации 2. Показатели колеблемости (вариации); Абсолютные показатели колеблемости (вариации) Метод анализа чувствительности в управлении риском 3. Рисковость актива и портфеля. Измерение систематического риска. Бета-коэффициент; Метод сценариев оценки риска 4. Уровень риска и ожидаемая доходность, премия риска. Количественный анализ рисков. Методы (модели) количественной оценки рисков Рекомендуемая литература: 8.1; 8.2, 8.3</p>	<p>Опрос. Обсуждение дискуссионных вопросов. Какую дополнительную информацию дает коэффициент вариации по сравнению с дисперсией. Решение тестовых и практических заданий</p>
<p>Критерии и методы оценки риска</p>	<p>1. Качественная и количественная оценка риска и возможности их применения Коэффициент награды за риск (индекс Трейнора) Реком. источники из 9 раздела: 5, 7, 8 2. Оценка уровня премий за акционерный риск. Модель CAPM Реком. источники из 9 раздела: 7, 8, 13 Показатель VALUE AT RISK (VAR) 2. Диверсификация риска; Портфельный анализ матрица (модель) БКГ. Рекомендуемая литература: 8.1; 8.2, 8.3</p>	<p>Опрос. Обсуждение дискуссионных вопросов. Решение тестовых и практических заданий</p>
<p>Риск - менеджмент в корпорации</p>	<p>1. Цели и задачи, принципы управления рисками в корпорации. Субъекты и объекты риск - менеджмента 2. Инструменты повышения качества процесса корпоративного управления в системе 3. Рекомендуемая литература: 8.1; 8.2, 8.3 4. Оценка ожидаемого экономического эффекта от принятия решений, направленных на повышения качества процесса корпоративного управления Рекомендуемая литература: 8.1; 8.2, 8.3</p>	<p>Опрос. Разбор тестовых заданий. Решение практических задач Дискуссия на тему «Выбор инструментов и методов управления рисками в корпорации»</p>
<p>Система</p>	<p>1. Финансовые риски и их место в системе рисков</p>	<p>Опрос. Решение</p>

управления финансовыми рисками корпорации	<p>корпорации.</p> <p>Особенности и цели проведения финансового анализа рисков корпоративных организаций</p> <p>2. Классификация и характеристика финансовых рисков по различным параметрам.</p> <p>Инструменты снижения финансового риска: опционы, фьючерсы</p> <p>3. Финансовое состояние корпорации и риск банкротства</p> <p>Рекомендуемая литература: 8.1; 8.2, 8.3</p>	практических задач и типовых ситуаций.
Нефинансовые риски корпорации	<p>1. Понятие и классификация нефинансовых рисков корпорации.</p> <p>Основные подходы к оценке нефинансовых рисков. 2. Нефинансовые риски корпорации при принятии инвестиционных решений. Процентный, валютный, кредитный риски</p> <p>Рекомендуемая литература: 8.1; 8.2, 8.3</p>	Проведение дискуссии по моделированию проблемных ситуаций и принятию решений в компаниях на тему: «Как безболезненно избавиться от сотрудников, составляющих группу риска. Меры снижения риска, связанного с психологическими особенностями поведения работников».
Управление рисками инновационных проектов	<p>1. Риски инновационно-инвестиционной деятельности. Источники неопределенности инвестиционной деятельности</p> <p>2. Этапы и организация риск-менеджмента инвестиционного проекта</p> <p>Анализ чувствительности критериев эффективности.</p> <p>Метод сценариев. Метод построения дерева событий. Метод «события - последствия». Метод деревьев отказов. Методы количественного риск-анализа инвестиционного проекта</p> <p>Рекомендуемая литература: 8.1; 8.2, 8.3</p>	Опрос. Обсуждение дискуссионных вопросов. Анализ юридической основы для проведения контроля: учредительные документы выбранной корпорации, решения общих собраний акционеров, решения советов директоров и других уполномоченных субъектов корпоративного управления, находящиеся в открытом доступе, а также уголовно-процессуальный кодекс.

## 6. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы

обучающихся по дисциплине

### 6.1. Перечень вопросов, отводимых на самостоятельное освоение дисциплины, формы внеаудиторной самостоятельной работы

Наименование тем (разделов) дисциплины	Перечень вопросов, отводимых на самостоятельное освоение	Формы внеаудиторной самостоятельной работы
--	--	--

1. Понятие и классификация рисков	Историческое развитие взглядов ведущих экономистов на понятие риска.	Подготовка к практическим занятиям, изучение литературы и нормативного материала, подготовка к дискуссии по проблемным вопросам темы
2. Диагностика рисков	Экспресс-диагностика. Прогноз- диагностика. Сигнальные карты рисков. Карта индивидуального риска.	Подготовка к практическим занятиям, изучение литературы и нормативного материала; подготовка к дискуссии по проблемным вопросам темы. Знакомство с аналитическими информационными и правовыми системами.
3. Методы анализа рисков. Расчет уровня риска	Используя открытые информационные источники (печатные издания, интернет-ресурсы) выбрать для анализа разработки и принятия управленческих решений действующую публичную корпорацию, входящую в Топ-100 крупнейших по капитализации публичных компаний России на последнюю отчетную дату по данным экспертов рейтингового агентства «РИА Рейтинг». Проанализировать систему рискменеджмента. Сформулировать принципы анализа рисков в корпорации.	Подготовка к практическим занятиям, изучение литературы и нормативного материала; подготовка к дискуссии по проблемным вопросам темы
4. Критерии и методы оценки риска	Обосновать критериальные показатели оценки риска для выбранной корпорации, вероятность и достоверность оценки. Оценить возможные виды потерь и их источники. Типичные и специфические риски в деятельности корпораций	Подготовка к практическим занятиям, изучение нормативных документов, основной и дополнительной литературы. Подготовка к дискуссии по проблемным вопросам темы. Использование аналитических информационных систем для поиска информации для выполнения практических заданий.
5. Риск - менеджмент в корпорации	Разработать проект оценки системы риск - менеджмента выбранной корпорации. Проанализировать методы управления рисками в различных сферах деятельности корпорации и на различных стадиях ее жизненного цикла.	Подготовка к практическим занятиям, выступлений по проблеме экономического обоснования управленческих решений. Расчет ключевых экономических показателей при реализации управленческих решений

6. Система управления финансовыми рисками корпорации	Используя метод экспертных процедур оценить кредитные риски: прямой, риск дефолта по ценным бумагам, риск неисполнения обязательств, риски по производным финансовым инструментам, расчетный риск для действующей публичной корпорации, входящей в Топ-100 крупнейших по	Подготовка к практическим занятиям. Подготовка анализа финансового состояния корпорации с позиций управления собственностью акционеров. Методы управления рисками в различных сферах деятельности
	капитализации публичных компаний России	и на различных стадиях жизненного цикла корпораций. Участие в НИРС
7. Нефинансовые риски корпорации	Риски текущей производственной деятельности. Риски технико-технологических преобразований и реформирования организационно-правовой структуры корпорации. Оценить нефинансовые риски выбранной компании. Оценить включенность нефинансовых рисков в общую систему управления рисками корпорации. Исследовать особенности управления нефинансовыми рисками	Подготовка к практическим занятиям, выступлений по проблеме принятия управленческих решений в условиях неопределенности и риска.
8. Управление рисками инновационно-инвестиционных проектов	Рассчитать риск проекта (материал взять из открытых источников), действующей публичной корпорации, входящей в Топ-100 крупнейших по капитализации публичных компаний России	Подготовка к практическим занятиям, выступлений по проблеме экономического обоснования управленческих решений. Подготовка проекта «Системы рискменеджмента в российских корпорациях» Участие в НИРС

## 6.2. Перечень вопросов, заданий, тем для подготовки к текущему контролю

### Тематика домашнего творческого задания:

1. Понятие риска в научном и прикладном значениях
2. Субъективная основа предпринимательского риска. Типы отношения к риску ЛПП
3. В чем различие между чистыми и спекулятивными рисками. Назовите примеры тех и других
4. Выявление потенциальных областей риска, диагностика и оценка возможности предотвращения или минимизации возникновения рисков
5. Управленческие инструменты и механизмы, обеспечивающие эффективную диагностику рисков.
6. Определение рискового спектра компании. Понятия: рисковое поле, рисковый ландшафт, рисковый профиль
7. Установление актуального рискового профиля
8. Метод сценариев оценки риска

9. Оценка влияния каждого показателя по методу дерева решений в управлении риском
  10. Метод Монте-Карло (статистических испытаний)
  11. Методы экспертных оценок риска. Метод "Дельфи".
  12. Координация (согласование) мнений экспертов.
  - 13.13. Что представляет собой расчет индекса Трейнора. С какой целью он рассчитывается
  14. Размер премии за риск инвестирования в акционерный капитал, ERP-ImpliedEquityRiskPremium
  15. Избежание риска как наиболее простой метод управления рисками, выбор мероприятий
  16. Принятие (сохранение) риска, оправданность выбора
  17. Принципы стратегии риск-менеджмента: принцип максимизации, принцип минимизации, принцип адекватности, принцип принятия
  18. Правила стратегии риск-менеджмента: максимум выигрыша, оптимальная вероятность результата, оптимальная колеблемость результата, оптимальное сочетание выигрыша и величины риска.
  19. Эвристические правила риск - менеджмента
  20. Особенности и цели проведения финансового анализа рисков корпоративных организаций
  21. Факторы, влияющие на уровень финансовых рисков корпорации: объективные и субъективные.
  22. Финансовое состояние корпорации и риск банкротства. Основные направления восстановления платежеспособности и снижения риска банкротства корпорации.
  23. Определение предельно допустимого уровня финансовых рисков по отдельным финансовым операциям и видам финансовой деятельности корпорации
  24. Риски корпоративного управления и государственного регулирования
  25. Нефинансовые риски корпорации при принятии инвестиционных решений
  26. Риски технико - технологических преобразований и реформирования организационно - правовой структуры корпорации
  27. Риски инновационно- инвестиционной деятельности. Источники
  28. Этапы и организация риск - менеджмента инвестиционного проекта
  29. Анализ чувствительности критериев эффективности. Метод сценариев
- Критерии балльной оценки различных форм текущего контроля успеваемости содержатся в соответствующих методических рекомендациях департамента.

**7. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине**

Перечень компетенций, формируемых в процессе освоения дисциплины, содержится в разделе 2. Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы (перечень компетенций) с указанием индикаторов их достижения и планируемых результатов обучения по дисциплине

**Перечень вопросов к зачету.**

1. Понятие риска в научном и прикладном значениях
2. Субъективная основа предпринимательского риска. Типы отношения к риску  
ЛПР
3. Отношение компаний к риску и подходы к управлению рисками. Толерантность к риску
4. Отношение компаний к риску и подходы к управлению рисками. Толерантность к риску
5. В чем различие между чистыми и спекулятивными рисками. Назовите примеры тех и других
6. Какие классификации рисков Вам известны
7. Выявление потенциальных областей риска, диагностика и оценка возможности предотвращения или минимизации возникновения рисков
8. Управленческие инструменты и механизмы, обеспечивающие эффективную диагностику рисков.
9. Этапы диагностики рисков компании
10. Определение рискового спектра компании. Понятия: рисковое поле, рисковый ландшафт, рисковый профиль
11. Установление актуального рискового профиля
12. Абсолютные показатели колеблемости (вариации)
13. Рисковость актива и портфеля
14. Метод анализа чувствительности в управлении риском.
15. Метод сценариев оценки риска
16. Количественный анализ рисков. Методы (модели) количественной оценки рисков
17. Оценка влияния каждого показателя по методу дерева решений в управлении риском
18. Метод Монте-Карло (статистических испытаний)
19. Методы экспертных оценок риска. Метод "Дельфи".
20. Координация (согласование) мнений экспертов.
21. Что представляет собой расчет индекса Трейнора. С какой целью он рассчитывается
22. Ставка свободная от риска. Доходность безрисковых активов
23. Премия риска рыночного портфеля

24. Размер премии за риск инвестирования в акционерный капитал, ERP-ImpliedEquityRiskPremium

25. Методы, используемые на этапе выявления рисков

26. Избежание риска как наиболее простой метод управления рисками, выбор мероприятий

27. Принятие (сохранение) риска, оправданность выбора

28. Принципы стратегии риск-менеджмента: принцип максимизации, принцип минимизации, принцип адекватности, принцип принятия

29. Правила стратегии риск-менеджмента: максимум выигрыша, оптимальная вероятность результата, оптимальная колеблемость результата, оптимальное сочетание выигрыша и величины риска.

30. Эвристические правила риск -менеджмента

31. Особенности и цели проведения финансового анализа рисков корпоративных организаций 32. Факторы, влияющие на уровень финансовых рисков корпорации: объективные и субъективные.

33. Финансовое состояние корпорации и риск банкротства. Основные направления восстановления платежеспособности и снижения риска банкротства корпорации.

#### **Перечень вопросов к экзамену.**

34. Понятие риска в научном и прикладном значениях

35. Субъективная основа предпринимательского риска. Типы отношения к риску  
ЛПР

36. Отношение компаний к риску и подходы к управлению рисками. Толерантность к риску

37. Отношение компаний к риску и подходы к управлению рисками. Толерантность к риску

38. В чем различие между чистыми и спекулятивными рисками. Назовите примеры тех и других

39. Какие классификации рисков Вам известны

40. Выявление потенциальных областей риска, диагностика и оценка возможности предотвращения или минимизации возникновения рисков

41. Управленческие инструменты и механизмы, обеспечивающие эффективную диагностику рисков.

42. Этапы диагностики рисков компании

43. Определение рискового спектра компании. Понятия: рисковое поле, рисковый ландшафт, рисковый профиль

44. Установление актуального рискового профиля

45. Абсолютные показатели колеблемости (вариации)

46. Рисковость актива и портфеля

47. Метод анализа чувствительности в управлении риском.

48. Метод сценариев оценки риска
49. Количественный анализ рисков. Методы (модели) количественной оценки рисков
50. Оценка влияния каждого показателя по методу дерева решений в управлении риском
51. Метод Монте-Карло (статистических испытаний)
52. Методы экспертных оценок риска. Метод "Дельфи".
53. Координация (согласование) мнений экспертов.
54. Что представляет собой расчет индекса Трейнора. С какой целью он рассчитывается
55. Ставка свободная от риска. Доходность безрисковых активов
56. Премия риска рыночного портфеля
57. Размер премии за риск инвестирования в акционерный капитал, ERP-ImpliedEquityRiskPremium
58. Методы, используемые на этапе выявления рисков
59. Избежание риска как наиболее простой метод управления рисками, выбор мероприятий
60. Принятие (сохранение) риска, оправданность выбора
61. Принципы стратегии риск-менеджмента: принцип максимизации, принцип минимизации, принцип адекватности, принцип принятия
62. Правила стратегии риск-менеджмента: максимум выигрыша, оптимальная вероятность результата, оптимальная колеблемость результата, оптимальное сочетание выигрыша и величины риска.
63. Эвристические правила риск -менеджмента
64. Особенности и цели проведения финансового анализа рисков корпоративных организаций
65. Факторы, влияющие на уровень финансовых рисков корпорации: объективные и субъективные.
66. Финансовое состояние корпорации и риск банкротства. Основные направления восстановления платежеспособности и снижения риска банкротства корпорации.
67. Определение предельно допустимого уровня финансовых рисков по отдельным финансовым операциям и видам финансовой деятельности корпорации
68. Инструменты снижения финансового риска: опционы, фьючерсы.
69. Хеджирование как инструмент управления финансовыми рисками
70. Хеджирование с помощью фьючерсных контрактов
71. Хеджирование с использованием обменных контрактов (сделки СВОП)
72. Характеристика основных нефинансовых рисков корпорации
73. Риски корпоративного управления и государственного регулирования
74. Нефинансовые риски корпорации при принятии инвестиционных решений

75. Риски текущей производственной деятельности
76. Риски технико -технологических преобразований и реформирования организационно -правовой структуры корпорации
77. Оценка нефинансовых рисков
78. Риски инновационно-инвестиционной деятельности. Источники неопределенности инвестиционной деятельности.
79. Этапы и организация риск -менеджмента инвестиционного проекта
80. Анализ чувствительности критериев эффективности. Метод сценариев

### **Пример экзаменационного билета**

**Федеральное государственное образовательное бюджетное учреждение высшего образования «Финансовый университет при Правительстве РФ»  
Новороссийский филиал Финуниверситета**

Кафедра «Экономика, финансы и менеджмент»

Дисциплина «Управление рисками в корпорациях»

Форма обучения заочная

Семестр 7

Направление 38.03.02 «Менеджмент» Профиль «Корпоративное управление»

### **ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 1**

1. (15 баллов) Охарактеризуйте порядок принятия решения о сдаче в аренду объекта имущественного комплекса акционерного общества с участием государства.

2. (15 баллов) Какие принципы социальной ответственности корпораций Вы знаете. Как их использовать при разработке стратегии развития корпорации? 3. Задача (30 баллов) Разработать план приватизации предприятия.

Объектом приватизации является Государственное унитарное предприятие Московской области «ПОДОЛЬСКОЕ ЛЕСОТОПЛИВНОЕ ПРЕДПРИЯТИЕ» расположенное на территории города Подольск.

ГУП МО «Подольское лесотопливное предприятие» осуществляет деятельность по хранению и реализации топлива, предприятие специализируется на продаже оптом и в розницу угля, торфа и торфо-брикета. В хозяйственном ведении предприятия находится 13 объектов недвижимого имущества, общей площадью 8 тыс. кв.м., включающих в себя Административное здание, Здание гаража, Открытая железобетонная площадка, ЖД подъездной путь.

Площадь 3 земельных участков находящихся в пользовании предприятия - 2,92 га. На предприятии трудятся 16 человек. На территории предприятия размещены складские, производственные и автопарковые мощности для хранения и осуществления оптом и в розницу угля, торфа и торфо-брикета.

Предприятие несколько раз, выступало в качестве ответчика по долговым искам в Арбитражном суде и требованиям признания его банкротом. У предприятия возникли долги по эксплуатации, ремонту и восстановлению и обслуживанию территории и транспортных расходов перед рядом юридических лиц, а также имеющиеся долги по зарплате перед работниками предприятия. Убыток от продаж компании ГУП МО ПЛТП за 2018 год составил 2,27 млн. руб. против прибыли в 275,00 тыс. руб. годом ранее.

На основании всего выше указанного, на предприятии сложилась неблагоприятная хозяйственно-экономическая ситуация и предприятие не регулярно и исключительно частично, выплачивает имеющиеся задолженности, определенные на основании оказанных услуг предприятию по договорам и подтвержденные в судебном порядке.

Балансирует на грани признания его полностью несостоятельным, банкротом, в совокупности с имеющимся долгом по зарплате сотрудникам, что может спровоцировать массовое увольнение сотрудников до 90 % состава, остановку работы предприятия, отсутствие возможности работы по заключенным ранее договорам на поставку продукции.

Подготовил: \_\_\_\_\_ (Зайковский Б.Б.)

Утверждаю:

Зав. кафедрой \_\_\_\_\_ (Четошникова Л.А.) Дата

«\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

**Примеры оценочных средств для проверки каждой компетенции, формируемой дисциплиной.**

Код компетенции	Наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции	Типовые задания
ПКН-11	Способность анализировать рыночные и специфические риски при решении задач управления организацией	1. Демонстрирует знания математических методов, применяемых в менеджменте.	Даны два варианта вложения капитала со следующими параметрами. Вариант 1 Прибыль при средней величине 500 тыс. руб. колеблется от 300 тыс. руб. до 600 тыс. руб. Вероятность получения прибыли в размере 300 тыс. руб. и 600 тыс. руб. равна 0,3 каждая. Вариант 2 Прибыль при средней величине 400 тыс. руб. колеблется от 250 тыс. руб. (с вероятностью 0,4) до 500 тыс. руб. (с вероятностью 0,3). Задание: Выберите наименее рискованный вариант вложения капитала. Критерием выбора является наименьшая величина коэффициента вариации.
		2. Применяет математические методы и модели для обоснования принятия управленческих решений.	Задание 1. Используя правило оптимальной вероятности результата, выберете приемлемый вариант. Данные для расчета. По первому варианту рискованного вложения капитала ожидается получить прибыль в 2 млн. руб. с вероятностью 0,9. по второму варианту вложения капитала ожидается получить прибыль 3,5 млн. руб. с вероятностью 0,7 Задание 2.

			<p>Возможные последствия принимаемых решений в условиях разной реакции рынка на новую продукцию представлены в таблице выплат (таблица 1).</p> <p>Выбрать эффективную стратегию, используя критерий максимакс, максиминный критерий Вальда и критерий Сэвиджа</p> <p>Таблица 1 - Выплаты</p> <table border="1" data-bbox="882 499 1509 925"> <thead> <tr> <th rowspan="2">Альтернативы</th> <th colspan="3">Размер выплат (млн. у.е.) при условии, что массовый спрос возникнет</th> </tr> <tr> <th>немедленно</th> <th>Через 1 год</th> <th>Через 2 года</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Перейти немедленно</td> <td>16</td> <td>6</td> <td>-6</td> </tr> <tr> <td>Перейти через 1 год</td> <td>5</td> <td>12</td> <td>2</td> </tr> <tr> <td>Перейти через 2 года</td> <td>0</td> <td>2</td> <td>6</td> </tr> </tbody> </table>	Альтернативы	Размер выплат (млн. у.е.) при условии, что массовый спрос возникнет			немедленно	Через 1 год	Через 2 года	Перейти немедленно	16	6	-6	Перейти через 1 год	5	12	2	Перейти через 2 года	0	2	6
Альтернативы	Размер выплат (млн. у.е.) при условии, что массовый спрос возникнет																					
	немедленно	Через 1 год	Через 2 года																			
Перейти немедленно	16	6	-6																			
Перейти через 1 год	5	12	2																			
Перейти через 2 года	0	2	6																			
		<p>3. Содержательно интерпретирует результаты, полученные при использовании математических моделей.</p>	<p>При вложении капитала в мероприятие А из 120 случаев прибыль в 25 тыс.руб. была получена в 48 случаях, прибыль 20 тыс. руб. была получена в 36 случаях, прибыль в 30 тыс.руб. была получена в 36 случаях.</p> <p>При вложении капитала в мероприятие Б (из 100 случаев) прибыль в 40 тыс.руб. была получена в 20 случаях, прибыль в 30 тыс. руб. была получена в 30 случаях, прибыль в 15 тыс. руб. была получена в 50 случаях.</p> <p>Выберите и аргументируйте наименее рискованный вариант вложения капитала.</p>																			
ПКП-3	<p>Владение методами и навыками разработки и организации процедур контроля в системе корпоративного управления</p>	<p>1. Применяет современные методы анализа действующей практики разработки и организации процедур контроля в системе корпоративного управления</p> <p>2. Определяет способы организации деятельности органов корпоративного контроля в компании</p>	<p>Компания «А» является инициатором слияния с компанией «В». Поскольку в процессе слияния происходит не выкуп акций, а их обмен, то компания «А» предлагает акционерам компании «В» обменять их акции на акции компании «А» в определенной пропорции, которая будет установлена исходя из соотношения цен акций «А» и «В».</p> <p>На момент предложения о слиянии акции компании «В» стоили на рынке 30 долл. Чтобы</p>																			

		<p>3. Организует эффективное взаимодействие органов корпоративного контроля корпоративного управления с целью повышения результативности их деятельности</p>	<p>простимулировать слияние компании «А» необходимо заинтересовать в этом акционеров компании» В». Поэтому компания «А» предлагает для обмена более высокую цену 35 долл. Повышение цены обмена выгодно для акционеров компании «В», поскольку позволит получить в обмен за свои акции большее количество акций «А» нежели при цене 30 долл.</p> <p>Однако, учитывая исходную финансовую информацию обеих компаний, необходимо определить, действительно ли цена 35 долл. выгодна для акционеров компании «В» и не столкнутся ли они с реализацией риска размывания прибыли на акцию?</p> <p>Исходная финансовая информация:</p>																				
			<table border="1"> <thead> <tr> <th data-bbox="884 943 1125 987">Показатели</th> <th data-bbox="1125 943 1299 987">А</th> <th data-bbox="1299 943 1508 987">В</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="884 987 1125 1099">1. Текущая прибыль (долл.)</td> <td data-bbox="1125 987 1299 1099">20 000 000</td> <td data-bbox="1299 987 1508 1099">5 000 000</td> </tr> <tr> <td data-bbox="884 1099 1125 1178">2. Количество акций (шт.)</td> <td data-bbox="1125 1099 1299 1178">5 000 000</td> <td data-bbox="1299 1099 1508 1178">2 000 000</td> </tr> <tr> <td data-bbox="884 1178 1125 1256">3. Прибыль на акцию (долл.)</td> <td data-bbox="1125 1178 1299 1256">4.0</td> <td data-bbox="1299 1178 1508 1256">2.5</td> </tr> <tr> <td data-bbox="884 1256 1125 1335">4. Рыночная цена (долл.)</td> <td data-bbox="1125 1256 1299 1335">64</td> <td data-bbox="1299 1256 1508 1335">30</td> </tr> <tr> <td data-bbox="884 1335 1125 1556">5. Коэффициент (отношение цены акции к прибыли на акцию)</td> <td data-bbox="1125 1335 1299 1556">16</td> <td data-bbox="1299 1335 1508 1556">12</td> </tr> </tbody> </table>			Показатели	А	В	1. Текущая прибыль (долл.)	20 000 000	5 000 000	2. Количество акций (шт.)	5 000 000	2 000 000	3. Прибыль на акцию (долл.)	4.0	2.5	4. Рыночная цена (долл.)	64	30	5. Коэффициент (отношение цены акции к прибыли на акцию)	16	12
Показатели	А	В																					
1. Текущая прибыль (долл.)	20 000 000	5 000 000																					
2. Количество акций (шт.)	5 000 000	2 000 000																					
3. Прибыль на акцию (долл.)	4.0	2.5																					
4. Рыночная цена (долл.)	64	30																					
5. Коэффициент (отношение цены акции к прибыли на акцию)	16	12																					

ПКП-4	Способность к организации деятельности с целью организации управления акционерной(корпоративной) собственностью	1.Применяет современные методы управления акционерной (корпоративной) собственностью	<p>Компания рассматривает вопрос о строительстве завода. Возможны три варианта действий.</p> <p>А. Построить большой завод стоимостью 650 тыс. долл. При этом варианте возможны большой спрос (годовой доход в размере 120 тыс. долл в течение следующих пяти лет) с вероятностью 0,7 и низкий спрос (ежегодные убытки 85 тыс. долл.) с вероятностью 0,3.</p> <p>Б. Построить маленький завод стоимостью 360 тыс. долл.. При этом варианте возможны большой спрос (годовой доход в размере 120 тыс. долл. в течение следующих пяти лет) с вероятностью 0,7 и низкий спрос (ежегодные убытки 60 тыс. долл.) с вероятностью 0,3.</p>
-------	---	--	--

			<p>В. Отложить строительство завода на один год для сбора дополнительной информации, которая может быть позитивной и негативной с вероятностью 0,9 и 0,1 соответственно. В случае</p>
--	--	--	---

	<p>2. Организует взаимодействие органов корпоративного управления с целью эффективного управления акционерной (корпоративной) собственностью</p>	<p>Разработать план приватизации предприятия.</p> <p>Объектом приватизации является Государственное унитарное предприятие Московской области «ПОДОЛЬСКОЕ ЛЕСОТОПЛИВНОЕ ПРЕДПРИЯТИЕ» расположенное на территории города Подольск.</p> <p>ГУП МО «Подольское лесотопливное предприятие» осуществляет деятельность по хранению и реализации топлива, предприятие специализируется на продаже оптом и в розницу угля, торфа и торфо-брикета. В хозяйственном ведении предприятия находится 13 объектов недвижимого имущества, общей площадью 8 тыс. кв.м., включающих в себя Административное здание, Здание гаража, Открытая железобетонная площадка, ЖД подъездной путь.</p> <p>Площадь 3 земельных участков находящихся в пользовании предприятия - 2,92 га. На предприятии трудятся 16 человек. На территории предприятия размещены складские, производственные и автостояночные мощности для хранения и осуществления оптом и в розницу угля, торфа и торфо-брикета.</p> <p>Предприятие несколько раз, выступало в качестве ответчика по долговым искам в Арбитражном суде и требованиям признания его банкротом. У предприятия возникли долги по эксплуатации, ремонту и восстановлению и обслуживанию территории и транспортных расходов перед рядом юридических лиц, а также имеющиеся долги по зарплате перед работниками предприятия. Убыток от продаж компании ГУП МО ПЛТП за 2018 год составил 2,27 млн. руб. против прибыли в 275,00 тыс. руб. годом ранее.</p> <p>На основании всего выше указанного, на предприятии сложилась неблагоприятная хозяйственно-экономическая ситуация и предприятие не регулярно и исключительно частично, выплачивает имеющиеся задолженности, определенные на основании оказанных услуг предприятию по договорам и подтвержденные в судебном порядке.</p> <p>Балансирует на грани признания его полностью несостоятельным, банкротом, в совокупности с имеющимся долгам по зарплате сотрудникам, что может спровоцировать массовое увольнение сотрудников до 90 % состава, остановку работы предприятия, отсутствие возможности работы по заключенным ранее договорам на поставку продукции.</p>
--	--	---

		<p>3.Организует мониторинг оценки практики управления акционерной (корпоративной) собственностью</p>	<p>Разработать проект оценки системы риск менеджмента выбранной корпорации.          Проанализировать методы управления рисками в различных сферах деятельности корпорации и на различных стадиях ее жизненного цикла.</p>
--	--	--	--

## 8. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

### Нормативные правовые акты

1. Гражданский кодекс Российской Федерации, часть I от 30.11.1994 г. № 51-ФЗ (принята ГД ФС РФ 21.10.1994 г., действующая редакция от 13.07.2015 г.)  
[http://www.consultant.ru/document/cons\\_doc\\_LAW\\_5142/](http://www.consultant.ru/document/cons_doc_LAW_5142/)

2. Гражданский кодекс Российской Федерации, часть IV от 18.12.2006 г. № 230-ФЗ (принята ГД ФС РФ 24.11.2006 г., действующая редакция от 13.07.2015 г.)  
[http://www.consultant.ru/document/cons\\_doc\\_LAW\\_64629/](http://www.consultant.ru/document/cons_doc_LAW_64629/)

3. Закон об акционерных обществах от 26.12.1995 №208-ФЗ, с изменениями и дополнениями с 1 января 2017 г. Конституция Российской Федерации (принята на всенародном голосовании 12 декабря 1993 г.) (с поправками).  
[http://www.consultant.ru/document/cons\\_doc\\_LAW\\_8743/](http://www.consultant.ru/document/cons_doc_LAW_8743/)

4. ГОСТ 1.1-2002 «Межгосударственная система стандартизации. Термины и определения» <http://docs.cntd.ru/document/1200030741>

### Основная литература:

5. Авдийский В.И. Риски хозяйствующих субъектов: теоретические основы, методологии анализа, прогнозирования и управления : учеб. пособие / В.И. Авдийский, В.М. Безденежных. - Москва : Альфа-М : ИНФРА-М, 2018. - 368 с. - (Экономика). - Текст : непосредственный. - То же. - ЭБС Znanium.com. URL: <http://znanium.com/catalog/product/39413> (дата обращения: 10.10.2019)

6. Балдин К.В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учеб. пособие / К.В. Балдин, И.И. Передеряев, Р.С. Голов. - 3-е изд. - Москва : Дашков и К, 2017. - 418 с. - ЭБС Znanium.com. - URL: <http://znanium.com/catalog/product/415224> (дата обращения: 10.10.2019). - Текст : электронный.

### Дополнительная литература:

7. Гранатуров В.М. Экономический риск: сущность, методы измерения, пути снижения : учеб. пособие / В.М. Гранатуров. - 3-е изд., перераб. и доп. - Москва : Дело и Сервис, 2018. - 208 с. - URL: <http://znanium.com/catalog/product/956> - Текст : непосредственный.

8. Рыхтикова Н.А. Анализ и управление рисками организации : учеб. пособие / Н.А. Рыхтикова. - 3-е изд. - Москва : ИНФРА-М, 2018. - 248 с. - (Высшее образование: Бакалавриат). - ЭБС Znanium.com. - URL: <http://znanium.com/catalog/product/991965> (дата обращения: 10.10.2019). - Текст : электронный.

9. Серебрякова Т.Ю. Риски организации и внутренний экономический контроль : монография / Т.Ю. Серебрякова. - Москва : ИНФРА-М, 2018. - 111 с. - (Научная мысль). - ЭБС Znanium.com. - URL: <http://znanium.com/catalog/product/1031520> (дата обращения: 10.10.2019). - Текст : электронный.

10. Тепман Л.Н. Управление рисками в условиях финансового кризиса : учеб. пособие / Л.Н. Тепман, Н.Д. Эриашвили. - Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2018. - 295 с - URL: <http://znanium.com/catalog/product/991935>. - Текст : непосредственный.

11. Шапкин А.С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций / А.С. Шапкин, В.А. Шапкин. - 9-изд. - Москва : Дашков и К, 2018. - 544 с. - ЭБС Znanium.com. - URL: <http://znanium.com/catalog/product/339372> (дата обращения: 10.10.2019). - Текст : электронный.

## **8. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", необходимых для освоения дисциплины**

1. <http://www.corp-gov.ru>- Корпоративное управление в России
2. <http://www.amr.ru>- Ассоциация менеджеров России
3. <http://www.rid.ru>- Российский институт директоров
4. <http://www.mergers.ru>- Слияния и поглощения в России
5. <http://www.rbc.ru>- РосБизнесКонсалтинг
6. <http://www.standardandpoors.ru>- Рейтинговая служба "Стандарт энд Пуэрз"
7. <http://www.raexpert.ru>- Рейтинговое агентство ЭКСПЕРТ
8. <http://www.nccg.ru>- сайт «Национальный совет по корпоративному управлению»
9. <http://www.delo-press.ru>- сайт«Delo-press»
10. <http://www.iteam.ru>- портал технологий корпоративного управления iTeam;
11. <http://www.aup.ru>- административно-управленческий портал AUP;
12. <http://www.technormativ.ru> / - портал Технорматив - стандарты по нефти и газу.

## **10. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины**

### **Рекомендации по подготовке к семинарским занятиям**

Подготовку к семинарским занятиям следует планировать и готовиться систематически, так как темы дисциплины логически взаимосвязаны. Равное внимание следует уделять как учебной

литературе, так и научным публикациям. Особое внимание необходимо уделять работе с аналитическими и фактическими данными.

Студентам следует:

Прорабатывать рекомендованную преподавателем литературу к конкретному занятию;

- до очередного практического занятия по рекомендованным литературным источникам проработать теоретический материал, соответствующей теме занятия;
- при подготовке к практическим занятиям следует обязательно использовать не только учебную литературу, но и нормативные правовые акты и материалы периодической печати и интернетресурсы;
- теоретический материал следует соотносить с правовыми нормами, так как в них могут быть внесены изменения, дополнения, которые не всегда отражены в учебной литературе;
- в ходе семинара активно участвовать в рабочей группе по выполнению заданного задания, готовить краткие, четкие выступления, участвовать в обсуждении докладов и результатов;
- на занятии доводить каждую поставленную задачу до окончательного решения, демонстрировать понимание проведенных расчетов (анализов, ситуаций), в случае затруднений обращаться к преподавателю.

Не следует оставлять нерешенные вопросы, для выяснения и понимания содержания их решения следует задать преподавателю и коллегам вопросы по материалу, вызвавшему затруднения.

Студентам, пропустившим занятия выполнить задание семинарского занятия и представить результаты в процессе индивидуальной работы с преподавателем. Студенты, не предоставившие такие результаты или не участвующие активно в работе на семинарах, упускают возможность получить баллы за работу в соответствующем семестре.

Формы семинарских занятий, проводимых в интерактивной форме:

#### 1. Дискуссия

Дискуссия состоит из трех этапов:

На первой стадии вырабатывается определенная установка на решение поставленной проблемы. При этом перед студентом стоит задача уяснить проблему и цель дискуссии. Главное правило дискуссии – выступить должен каждый. Кроме того, необходимо: внимательно выслушивать выступающего, не перебивать, аргументировано подтверждать свою позицию, не повторяться, не допускать личной конфронтации, сохранять беспристрастность, не оценивать выступающих, не выслушав до конца и не поняв позицию.

Вторая стадия – стадия оценки – обычно предполагает ситуацию сопоставления, конфронтации и даже конфликта идей, который в случае неумелого руководства дискуссией может перерасти в конфликт личностей. На этой стадии перед студентом ставятся следующие задачи:

- начать обмен мнениями;
- собрать максимум мнений, идей, предложений. Выступая со своим мнением, студент может сразу внести свои предложения, а может сначала просто выступить, а позже сформулировать свои предложения.
- не уходить от темы;

- оперативно проводить анализ высказанных идей, мнений, позиций, предложений перед тем, как переходить к следующему витку дискуссии.

В конце дискуссии у студентов есть право самим оценить свою работу (рефлексия).

Третья стадия – стадия консолидации – предполагает выработку определенных единых или компромиссных мнений, позиций, решений. На этом этапе осуществляется контролирующая функция. Студенты анализируют и оценивают проведенную дискуссию, подводят итоги, результаты.

Подготовка к дискуссии включает в себя изучение материала, полученного на лекции и дополнительного материала, рекомендованного преподавателем.

#### **Методические указания для обучающихся по обсуждению кейсовой ситуации :**

- преподаватель самостоятельно делит группы на несколько подгрупп по 6-12 человек;
- студентам дается время на изучение кейса;
- обсуждение вопросов кейса в группе и выработка альтернативных решений;
- каждая группа предлагает свои альтернативные решения обозначенных в кейсе проблем;
- обсуждение вариантов решений всеми студентами из предложенных и выработка единого решения с аргументацией;
- совместно с преподавателем, который выступает в роли модератора – подводятся итоги и отмечаются положительные и отрицательные стороны.

### **11. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень необходимого программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости)**

При осуществлении образовательного процесса обучающимися и профессорско-преподавательским составом используются: программное обеспечение, информационно-справочные системы, электронные библиотечные системы.

#### **11.1 Комплект лицензионного программного обеспечения:**

1. Windows Microsoft office
2. Антивирусная защита ESET NOD32

#### **11.2 Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы :**

- Информационно-правовая система «Консультант Плюс» – Аналитическая система Bloomberg Professional.
- SPSS Statistics (Statistical Package for the Social Sciences – статистический пакет для социальных наук) .
- базы данных Росстата: ЦБСД, ЕМИСС, ССРД МВФ
- Электронная энциклопедия: <http://ru.wikipedia.org/wiki/Wiki>
- Система комплексного раскрытия информации «СКРИН» <http://www.skrin.ru/>

### **11.3 Сертифицированные программные и аппаратные средства защиты информации**

Сертифицированные программные и аппаратные средства защиты информации не предусмотрены.

### **12. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине**

Для осуществления образовательного процесса в рамках дисциплины необходимо наличие специальных помещений.

Специальные помещения представляют собой учебные аудитории для проведения лекций, семинарских и практических занятий, выполнения курсовых групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, а также помещения для самостоятельной работы и помещения для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования.

Проведение лекций и семинаров в рамках дисциплины осуществляется в помещениях:

- оснащенных демонстрационным оборудованием;
- оснащенных компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет»;
- обеспечивающих доступ в электронную информационнообразовательную среду университета.

Специальные помещения должны быть укомплектованы специализированной мебелью и техническими средствами обучения, служащими для представления учебной информации большой аудитории.