

Федеральное государственное образовательное бюджетное учреждение высшего образования

«ФИНАНСОВЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПРИ ПРАВИТЕЛЬСТВЕ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»

(Финансовый университет)

Новороссийский филиал

Кафедра «Экономика, финансы и менеджмент»

УТВЕРЖДАЮ

Директор филиала

Е.Н. Сейфиева
« 29 » 2019 г.



Е.А. Заболотняя

Риск-ориентированный подход в системе корпоративного управления

Рабочая программа дисциплины

для студентов, обучающихся по направлению подготовки 38.03.01 Экономика
профиль «Анализ и управление рисками организации» (очное обучение)

*Рекомендовано Ученым советом Новороссийского филиала Финуниверситета
протокол № 14 от 29 августа 2019 г.*

Одобрено кафедрой «Экономика, финансы и менеджмент»

протокол № 1 от 28 августа 2019 г.

Новороссийск 2019

Заболотняя Е.А. Риск-ориентированный подход в системе корпоративного управления: Рабочая программа дисциплины для студентов, обучающихся по направлению 38.03.01 «Экономика» профиль «Анализ и управление рисками организации» очное обучение (программа подготовки бакалавров). - Новороссийск: Финансовый университет, кафедра «Экономика, финансы и менеджмент», 2019. - 23 с.

Программа дисциплины «Риск-ориентированный подход в системе корпоративного управления» отражает формирование у обучающихся знаний о современных концепциях управления рисками, вопросах классификации и систематизации рисков в системе корпоративного управления, методах выявления и оценки рисков, механизмах внедрения системы управления рисками в корпоративный менеджмент.

Рабочая программа 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

1. Наименование дисциплины.....	4
2. Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы (перечень компетенций) с указанием индикаторов их достижения и планируемых результатов обучения по дисциплине.....	4
3. Место дисциплины в структуре образовательной программы.....	5
4. Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах и в академических часах с выделением объема аудиторной (лекции, семинары) и самостоятельной работы обучающихся	5
5. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) дисциплины с указанием их объемов (в академических часах) и видов учебных занятий	5
5.1. Содержание дисциплины.....	5
5.2. Учебно-тематический план.....	8
5.3. Содержание семинаров, практических занятий.....	10
6. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине	14
6.1. Перечень вопросов, отводимых на самостоятельное освоение дисциплины, формы внеаудиторной самостоятельной работы.....	14
6.2. Перечень вопросов, заданий, тем для подготовки к текущему контролю.....	16
7. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине	18
8. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины	20
9. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины:	21
10. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины.....	21
11. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень необходимого программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости).....	23
11.1. Комплект лицензионного программного обеспечения	23
11.2. Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы	23
11.3. Сертифицированные программные и аппаратные средства защиты информации	23
12. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине.....	23

1. Наименование дисциплины

Риск-ориентированный подход в системе корпоративного управления

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

Дисциплина «Риск-ориентированный подход в системе корпоративного управления» по направлению 38.03.01 «Экономика» профиль «Анализ и управление рисками организации» обеспечивает формирование следующих компетенций:

Код компетенции	Наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции	Результаты обучения (владения, умения и знания), соотнесенные с компетенциями/индикаторами достижения компетенции
ПКП-3	Способность поддержания устойчивого функционирования системы управления рисками	1. Соблюдает и поддерживает нормы профессиональной этики, нормы корпоративного управления и корпоративной культуры по рискам.	Знать нормы профессиональной этики, нормы корпоративного управления рисками. Уметь соблюдать нормы профессиональной этики, нормы корпоративного управления рисками.
		2. Устанавливает и поддерживает деловые контакты, связи, отношения и коммуникации с сотрудниками компании, проводит интервью с ответственными за риск сотрудниками.	Знать приемы делового общения и деловой коммуникации с ответственными за риск сотрудниками. Уметь устанавливать и поддерживать деловые контакты, связи, отношения и коммуникации с ответственными за риск сотрудниками.
		3. Оказывает помощь сотрудникам в выявлении и оценке новых рисков, представляет аналитическую информацию о рисках для руководителей и ответственных за мероприятия по рискам работников	Знать методы выявления и оценки новых рисков, поиска аналитической информации по рискам. Уметь использовать методы выявления и оценки новых рисков, поиска аналитической информации по рискам.
ПКП-4	Способность разрабатывать системы управления рисками в рамках отдельных бизнес-процессов, направлений, методическую и нормативную базу по обеспечению ее функционирования	1. Применяет основные положения международных стандартов по риск-менеджменту и смежным вопросам при разработке корпоративных нормативных актов по управлению рисками в организации и системы управления рисками.	Знать основные международные стандарты по риск-менеджменту и смежным вопросам. Уметь применять основные международные стандарты по риск-менеджменту и смежным вопросам при разработке корпоративных нормативных актов по управлению рисками в организации и системы управления рисками.
		2. Разрабатывает методическую документацию по управлению рисками с целью организации процесса управления рисками в организации с учетом отраслевых стандартов и принятой в организации классификацией	Знать методическую документацию по управлению рисками с учетом отраслевых стандартов и классификацией рисков, а также процедуру ее разработки. Уметь разрабатывать

		рисков.	методическую документацию по управлению рисками с учетом отраслевых стандартов и классификацией рисков.
		3. Осуществляет мониторинг системы управления рисками, актуализацию карт рисков по бизнес-процессам, направлениям бизнеса.	Знать систему управления рисками, карты рисков по бизнес-процессам, направлениям бизнеса. Уметь проводить мониторинг системы управления рисками, актуализировать карты рисков по бизнес-процессам, направлениям бизнеса.

3. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Риск-ориентированный подход в системе корпоративного управления» является дисциплиной модуля профиля для студентов, обучающихся по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика», профиль «Анализ и управление рисками организации».

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

2018, 2019 года приема очное обучение

Таблица 1

Вид учебной работы по дисциплине	Всего (в з/е и часах)	Семестр (модуль) 6 (в часах)	Семестр (модуль) 7 (в часах)
Общая трудоемкость дисциплины	8 з.е./288	180	108
Контактная работа - Аудиторные занятия	136	86	50
<i>Лекции</i>	50	34	16
<i>Семинары, практические занятия</i>	86	52	34
Самостоятельная работа	152	94	58
<i>Вид текущего контроля</i>	<i>Домашнее творческое задание Реферат</i>	<i>Домашнее творческое задание</i>	<i>Реферат</i>
Вид промежуточной аттестации	Экзамен Экзамен	Экзамен	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. Предмет, цели и задачи учебной дисциплины «Риск-ориентированный подход в системе корпоративного управления».

Понятие «корпоративное управление», «система корпоративного управления». Отделение собственности от управления и контроля от собственности в современных компаниях.

Элементы системы корпоративного управления. Открытость или раскрытие информации. Состав и функции совета директоров и ревизионной комиссии. Взаимодействие с внешними и внутренними аудиторами.

Американская (аутсайдерская) модель корпоративного управления. Германская (инсайдерская) модель корпоративного управления. Японская модель корпоративного управления. Семейная модель корпоративного управления. Особенности российской модели корпоративного управления.

Специфика и сущность рисков в различных моделях корпоративного управления. Возможные причины возникновения рисков. Риски, имеющие вероятностную и невероятностную природу. Объективная и субъективная неопределённость. Диагностика и классификация рисков. Типология рисков по различным классификационным признакам. Риски по их функциональной направленности. Чистые и спекулятивные риски. Производственный риск. Коммерческий риск. Финансовый риск. Риски, связанные с покупательной способностью денег. Инвестиционные риски. Селективные риски. Риск банкротства. Биржевые риски. Валютный риск. Региональный риск. Отраслевой риск. Инновационный риск. Риски неисполнения хозяйственных договоров.

Традиционный и современный подходы к управлению рисками нефинансовых компаний.

Тема 2. Управление рисками как элемент системы корпоративного управления.

Процесс управления рисками в организации, его элементы и этапы. Категории «риск» и «доходность».

Основные аксиомы риск-менеджмента. Законы управления рисками. Принципы риск-менеджмента.

Идентификация и анализ рисков. Понятия «интуиция», «инсайт», «эвристика». Функции риск-менеджмента и его организация в компании. Управление рисками по их типам. Манипулирование риском. Анализ альтернатив управления риском.

Методы минимизации негативного влияния неблагоприятных событий. Классификация методов управления рисками. Выбор методов управления риском. Разновидность контрактов (договоров) при передаче рисков. Интеграция как способ минимизации рисков, разновидности интеграции. Диверсификация как один из ключевых методов диссипации риска. Виды диверсификации. Методы компенсации риска, как предупреждающие методы управления рисками.

Тема 3. Процессный подход к управлению рисками в системе корпоративного управления.

Понятие и сущность процессного подхода. Технология управления. Внешний и внутренний мониторинг рисков. Специфика планирования в системе риск-менеджмента.

Организационная функция и функция мотивирования в системе риск-менеджмента. Регулирование, учет и контроль в управлении рисками. Оценка эффективности управления рисками.

Тема 4. Методология управления рисками в системе корпоративного управления.

Понятие и виды методов управления рисками. Правовые (юридические) методы управления рисками. Административные методы риск-менеджмента. Экономические методы управления рисками. Социальные методы управления рисками. Психологические методы управления рисками. Производственные методы управления рисками. Использование научно-прикладных методов управления в управлении рисками.

Тема 5. Политика, стратегия и тактика управления рисками.

Понятия «политика управления», «стратегия управления», «тактика управления».

Стратегия управления рисками. Стратегия конкуренции. Стратегия низких издержек. Стратегия дифференциации. Стратегия оптимальных издержек.

Основные формы политики риск-менеджмента: политика профилактики, политика нейтрализации последствий, политика стимулирования прибыли в ходе реализации проектов с высокой степенью риска.

Тактическое управление рисками. Особенности использования оперативных и резервных ресурсов при тактическом управлении рисками.

Принятие управленческих решений в условиях риска и неопределенности в системе корпоративного управления.

Тема 6. Внешние риски и методы управления ими.

Характеристика и структура внешней среды компании. Политические риски. Понятие и сущность экономических рисков. Природные риски. Национальные риски. Экологические риски. Особенности управления коммерческими рисками. Специфика управления демографическими рисками. Финансовые риски. Влияние криминогенных рисков на развитие бизнеса. Инновационные риски. Логистические риски. Общая характеристика отраслевых и структурных рисков.

Тема 7. Управление внутренними административными рисками.

Внутренняя среда организации как область возникновения внутренних административных рисков. Подходы к изучению и анализу внутренней среды организации и внутриорганизационных факторов. Управленческие дисфункции как причина возникновения внутренних рисков. Управление организационными рисками как решение проблемы разделения власти и двоевластия.

Управление техническими и производственными рисками. Коммуникативные риски и методы управления ими. Особенности управления социальными рисками. Психологические риски. Специфика возникновения и развития информационных рисков.

Тема 8. Специфика оценки и управления риском в бизнесе в условиях современных экономических преобразований.

Специфика определения, измерения и оценки рисков в условиях современной экономики. Анализ и оценка степени риска. Идентификация и концептуальные направления анализа рисков. Этапы идентификации и анализа рисков. Принципы информационного обеспечения системы управления риском. Полезность информации. Эффективность управления риском. Доступность информации. Достоверность информации. Рисковый капитал. Система неопределенностей. Полная неопределенность. Полная определенность. Частичная неопределенность. Критерии определения оптимальности в сфере неопределенности.

Научные основы идентификации рисков. Выявление, актуализация, систематизация и анализ рисков. Идентификация источников рисков, оценка и выявление приоритетов риск-факторов фирмы. Состав и последовательность работ по идентификации и ранжированию рисков. Методы диагностики рисков. Источники сбора информации для идентификации рисков. Методический арсенал диагностики рисков. Картографирование рисков фирмы. Особенности идентификации и картографирования рисков для российских компаний. Построение карты рисков. Различные варианты построения рискографии предприятия.

Управление риском в производственном и торговом бизнесе. Управление риском портфеля страховых услуг. Количественные методы оценки рисков: вероятностно-статистические методы, методы экспертных оценок. Кривая Лоренца как метод оценки рисков. Метод VAR оценки риска. Стресс-тестирование и бэк-тестирование.

Тема 9. Риск-ориентированный подход в управлении корпоративными финансами.

Планирование, оптимизация и исполнение бюджета компании производственной и торговой сферы. Управление риском в ценообразовании компаний.

Тема 10. Специфика инвестиционных рисков в корпоративном управлении.

Оценка риска инвестиционного проекта. Оптимизация инвестиционного бизнес-плана. Управление портфелем реальных инвестиционных проектов. Управление портфелем ценных бумаг. Выбор инвестиционного проекта в условиях риска. Анализ риска в инвестиционной программе с привлечением кредитов. Выбор оптимального инвестиционного проекта. Метод "ПАТТЕРН". График вероятностей периодов погашения кредита. Суммарные значения вероятностей периодов погашения кредита. Совокупные вероятности обобщенных периодов окупаемости в программах инвестирования. Объем собственных средств, вкладываемых в проект. Интегральные показатели эффективности.

Оценка эффективности проекта в целом; участия в проекте. Анализ значений риска портфелей. Портфельный подход в нефинансовых корпорациях.

Тема 11. Риск-ориентированный подход в антикризисном управлении.

Риск банкротства и способы его оценки. Управление риском банкротства. Оптимизация плана внешнего управления. Понятие кредитного рейтинга, частоты дефолта, кредитного спреда, уровня восстановления. Обзор моделей оценки кредитного риска. Корпоративные стандарты кредитной политики на основе внутренних кредитных рейтингов контрагентов. Внутренний корпоративный рейтинг контрагентов на основе скоринга. Экспертная оценка волатильности активов фирмы. Расчет вероятности дефолта и распределения убытков с использованием структурных моделей для отдельных компаний. Агрегированный подход к расчету рыночного и кредитного рисков. Современные методы управления рыночным и кредитным риском. Риски предприятия в стратегической модели финансовой политики предприятия, ориентированной на повышение стоимости (модель Мертона). Валютное хеджирование. Хеджирование ставок. Снижение стоимости финансирования. Товарное хеджирование. Финансовая инженерия.

Тема 12. Информационные технологии в управлении рисками.

EVA и RAROC. Принципы увеличения стоимости с помощью риск-менеджмента. Размещение капитала с учетом риска. Риск-менеджмент проектов. Управление риском при слияниях и поглощениях. Организация риск-менеджмента на фирме: организационная структура, распределение обязанностей, роль и функции риск-менеджеров: координационная, организующая, образовательная. Место подсистемы управления рисками в общей структуре предприятия. Влияние подсистемы управления рисками на принятие корпоративных решений. Взаимоотношения отдела по управлению рисками с другими подразделениями компании. Бюджетирование системы управления рисками. Использование системы бюджетирования рисков в российских компаниях.

5.2. Учебно-тематический план

2018 года приема очное

Таблица 2

№	Наименование темы (раздела) дисциплины	Трудоёмкость в часах						Формы текущего контроля успеваемости
		Всего	Аудиторная работа				Самостоятельная работа	
			Общая	Лекции	Семинары, практические занятия	Занятия в интерактивных формах		
6 семестр								
1	Тема 1. Предмет, цели и задачи учебной дисциплины «Риск-ориентированный подход в системе корпоративного управления»	26	12	4	8	7	14	Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов
2	Тема 2. Управление рисками как элемент системы корпоративного управления	30	14	6	8	7	16	Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов
3	Тема 3. Процессный подход к управлению	30	14	6	8	7	16	Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение

	рисками в системе корпоративного управления							презентаций и докладов
4	Тема 4. Методология управления рисками в системе корпоративного управления	30	14	6	8	7	16	Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов
5	Тема 5. Политика, стратегия и тактика управления рисками	32	16	6	10	7	16	Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов
6	Тема 6. Внешние риски и методы управления ими	32	16	6	10	8	16	Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов
	В целом за 6 семестр	180	86	34	52	43	94	<i>Домашнее творческое задание</i>
	ИТОГО в %					50%		
7 семестр								
7	Тема 7. Управление внутренним и административными рисками	16	6	2	4	4	10	Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов
8	Тема 8. Специфика оценки и управления риском в бизнесе в условиях современных экономических преобразований	18	8	2	6	4	10	Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов
9	Тема 9. Риск-ориентированный подход в управлении корпоративными финансами	18	8	2	6	4	10	Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов
10	Тема 10. Специфика инвестиционных рисков в корпоративном управлении	18	8	2	6	4	10	Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов
11	Тема 11. Риск-ориентированный подход в антикризисном	18	8	2	6	4	10	Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение

	управлении							презентаций и докладов
12	Тема 12. Информационные технологии в управлении рисками	20	12	6	6	5	8	Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов
	В целом за 7 семестр	108	50	16	34	25	58	<i>Реферат</i>
	ИТОГО в %					50%		
	В целом по дисциплине	288	136	50	86	68	152	<i>Домашнее творческое задание Реферат</i>
	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
Тема 1. Предмет, цели и задачи учебной дисциплины «Риск-ориентированный подход в системе корпоративного управления»	<ol style="list-style-type: none"> 1. Определение понятий «корпоративное управление», «система корпоративного управления», «риск», «риск-менеджмент». 2. Организационно-правовые формы организации бизнеса и их характеристика. 3. Собственники и управленцы. Проблемы контроля в бизнесе. Функции совета директоров и ревизионной комиссии. 4. Элементы системы корпоративного управления. Взаимодействие с внешними и внутренними аудиторами. 5. Особенности моделей корпоративного управления: американская (аутсайдерская), германская (инсайдерская), японская, семейная, российская. 6. Риски в различных моделях корпоративного управления. 7. Особенности классификации и диагностики рисков. 8. Специфика производственного риска. 9. Коммерческий риск. 10. Финансовый риск. 11. Риск банкротства. 12. Региональный риск. 13. Отраслевой риск. 14. Инновационный риск. 15. Специфика управления рисками нефинансовых компаний. Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5	Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов
Тема 2. Управление рисками как элемент системы корпоративного управления	<ol style="list-style-type: none"> 1. Основные законы и принципы риск- менеджмента. 2. Соотношение понятий «интуиция», «инсайт», «эвристика». 3. Функции риск-менеджмента. 4. Особенности организации риск- менеджмента в компании. 5. Манипулирование риском. 6. Анализ альтернатив управления риском. 7. Классификация методов управления рисками. 8. Выбор методов управления риском. 	Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов

	<p>9. Разновидность контрактов (договоров) при передаче рисков.</p> <p>10. Интеграция как способ минимизации рисков, разновидности интеграции.</p> <p>11. Диверсификация как один из ключевых методов диссипации риска. Виды диверсификации.</p> <p>12. Методы компенсации риска, как упреждающие методы управления рисками.</p> <p>Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5</p>	
Тема 3. Процессный подход к управлению рисками в системе корпоративного управления	<p>1. Понятие процессного подхода в управлении. Процессный подход в риск- менеджменте.</p> <p>2. Специфика внешнего и внутреннего мониторинга рисков.</p> <p>3. Планирование в системе риск- менеджмента.</p> <p>4. Организационная функция в системе риск- менеджмента.</p> <p>5. Специфика и функции мотивирования в системе риск- менеджмента.</p> <p>6. Регулирование, учет и контроль в управлении рисками.</p> <p>7. Оценка эффективности управления рисками с точки зрения процессного подхода в управлении.</p> <p>Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5</p>	Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов
Тема 4. Методология управления рисками в системе корпоративного управления	<p>1. Понятие и виды методов управления рисками.</p> <p>2. Правовые (юридические) методы управления рисками.</p> <p>3. Административные методы риск- менеджмента.</p> <p>4. Экономические методы управления рисками.</p> <p>5. Социальные методы управления рисками.</p> <p>6. Психологические методы управления рисками.</p> <p>7. Производственные методы управления рисками.</p> <p>8. Выбор метода управления рисками. Оценка эффективности выбранного метода.</p> <p>Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5</p>	Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов
Тема 5. Политика, стратегия и тактика управления рисками	<p>1. Определение понятий «политика управления», «стратегия управления», «тактика управления».</p> <p>2. Содержание понятия «стратегия управления рисками».</p> <p>3. Стратегия конкуренции.</p> <p>4. Стратегия низких издержек.</p> <p>5. Стратегия дифференциации.</p> <p>6. Стратегия оптимальных издержек.</p> <p>7. Политика профилактики как форма политики риск- менеджмента</p> <p>8. Политика нейтрализации последствий</p> <p>9. Политика стимулирования прибыли в ходе реализации проектов с высокой степенью риска.</p> <p>10. Сущность тактического управления рисками.</p> <p>11. Использование оперативных и резервных ресурсов при тактическом управлении рисками.</p> <p>12. Специфика принятия управленческих решений в условиях риска и неопределенности в системе корпоративного управления.</p> <p>Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5</p>	Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов

<p>Тема 6. Внешние риски и методы управления ими</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. Определение понятия «внешняя среда компании». 2. Структура внешней среды компании. Характеристика составных элементов. 3. Политические риски и их влияние на компанию. 4. Внешние экономические риски. 5. Природные риски. 6. Национальные риски. 7. Экологические риски. 8. Особенности управления коммерческими рисками. 9. Демографические риски и специфика управления ими. 10. Финансовые риски. 11. Влияние криминогенных рисков на развитие бизнеса. 12. Инновационные риски. 13. Логистические риски. 14. Отраслевые и структурных риски. Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5 	<p>Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов</p>
<p>Тема 7. Управление внутренними административными рисками</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. Содержание понятия «внутренняя среда организации». 2. Внутренняя среда как область возникновения внутренних административных рисков. 3. Внутриорганизационные факторы рисков. 4. Специфика управленческих дисфункций как причины возникновения внутренних рисков. 5. Специфика управления организационными рисками. 6. Технические и производственные риски. 7. Коммуникативные риски и методы управления ими. 8. Социальные и психологические риски, специфика управления ими. 9. Специфика возникновения и управления информационными рисками. <p>Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5.</p>	<p>Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов</p>
<p>Тема 8. Специфика оценки и управления риском в бизнесе в условиях современных экономических преобразований</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. Специфика современной экономики с позиции процессов глобализации. 2. Влияние применяемых мировым сообществом методов регулирования международной торговли (тарифные, нетарифные методы регулирования, санкции) на деятельность национальных компаний. 3. Специфика определения, измерения и оценки рисков в условиях современной экономики. 4. Проблемы и специфика информационного обеспечения системы управления риском в условиях экономических изменений. 5. Подходы к оценке эффективности управления риском. 6. Специфика выявления, актуализации, систематизации и анализа рисков в условиях современной экономики. 7. Особенности идентификации и картографирования рисков для российских компаний. 8. Управление риском в производственном и торговом бизнесе в условиях санкций. 9. Управление риском портфеля страховых услуг. 10. Количественные методы оценки рисков: вероятностно-статистические методы, методы экспертных оценок. 11. Кривая Лоренца как метод оценки рисков. 12. Метод VAR оценки риска. 13. Стресс-тестирование и бэк-тестирование. <p>Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5.</p>	<p>Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов</p>

<p>Тема 9. Риск-ориентированный подход в управлении корпоративными финансами</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. Планирование, оптимизация и исполнение бюджета компании производственной и торговой сферы. 2. Специфика операционного бюджетирования в условиях риск-ориентированного подхода. 3. Управление риском в ценообразовании компаний. <p>Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5.</p>	<p>Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов</p>
<p>Тема 10. Специфика инвестиционных рисков в корпоративном управлении</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. Специфика оценки рисков инвестиционных проектов. 2. Выбор инвестиционного проекта в условиях риска. Анализ риска в инвестиционной программе с привлечением кредитов. 3. Особенности оптимизация инвестиционного бизнес-плана. 4. Управление портфелем реальных инвестиционных проектов в условиях риск-ориентированного подхода. 5. Специфика выбора оптимального инвестиционного проекта. 6. Интегральные показатели эффективности инвестиционных проектов. 7. Анализ значений риска портфелей. 8. Специфика портфельного подхода в нефинансовых организациях. <p>Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5.</p>	<p>Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов</p>
<p>Тема 11. Риск-ориентированный подход в антикризисном управлении</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. Понятие банкротства 2. Факторы банкротства. 3. Определение понятия «риск банкротства». 4. Способы оценки риска банкротства. 5. Управление риском банкротства. 6. Оптимизация плана внешнего управления. 7. Понятие кредитного рейтинга, частоты дефолта, кредитного спреда, уровня восстановления. 8. Модели оценки кредитного риска. 9. Корпоративные стандарты кредитной политики на основе внутренних кредитных рейтингов контрагентов. 10. Внутренний корпоративный рейтинг контрагентов на основе скоринга. 11. Экспертная оценка волатильности активов фирмы. 12. Расчет вероятности дефолта и распределения убытков. 13. Специфика расчета рыночного и кредитного рисков. 14. Специфика управления рыночным и кредитным риском в современных условиях. 15. Риски предприятия в стратегической модели финансовой политики предприятия, ориентированной на повышение стоимости (модель Мертона). 16. Хеджирование как метод риск-менеджмента. <p>Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5.</p>	<p>Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов</p>
<p>Тема 12. Информационные технологии в управлении рисками</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. EVA и RAROC. Принципы увеличения стоимости с помощью риск менеджмента. 2. Размещение капитала с учетом риска. 3. Управление риском при слияниях и поглощениях. 4. Организация риск-менеджмента в компании. 5. Особенности реализации функций риск-менеджеров. 6. Место подсистемы управления рисками в общей структуре организации и ее влияние на принятие корпоративных решений. 7. Взаимоотношения отдела по управлению рисками с другими подразделениями компании. 8. Бюджетирование системы управления рисками. 	<p>Научная, дискуссия, заслушивание и обсуждение презентаций и докладов</p>

	Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5.	
--	--	--

6. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

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

Таблица 4

Наименование тем (разделов) дисциплины	Перечень вопросов, отводимых на самостоятельное освоение	Формы внеаудиторной самостоятельной работы
Тема 1. Предмет, цели и задачи учебной дисциплины «Риск-ориентированный подход в системе корпоративного управления»	<ol style="list-style-type: none"> 1. Специфика отделения собственности от управления и контроля от собственности в современных компаниях. 2. Практические примеры открытости или раскрытия информации в деятельности компаний. 3. Систематизация рисков в различных моделях корпоративного управления. 4. Практические примеры управления производственным риском. 5. Оценка риск банкротства на практическом примере компании. 6. Способы управления валютным риском при внешнеэкономических отношениях. <p>Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5.</p>	Изучение учебной литературы. Подготовка к научной дискуссии, докладам и презентациям. Подготовка домашнего творческого задания.
Тема 2. Управление рисками как элемент системы корпоративного управления	<ol style="list-style-type: none"> 1. Организация функции риск-менеджмента в компании (анализ и оценка на конкретных примерах). 2. Практические примеры передачи рисков: издержки и результаты. 3. Методы компенсации риска, как упреждающие методы управления рисками. <p>Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5.</p>	Изучение учебной литературы. Подготовка к научной дискуссии, докладам и презентациям. Подготовка домашнего творческого задания.
Тема 3. Процессный подход к управлению рисками в системе корпоративного управления	<ol style="list-style-type: none"> 1. Практика внешнего и внутреннего мониторинга рисков. 2. Специфика практической реализации функции мотивирования в системе риск-менеджмента. 3. Практика оценки эффективности управления рисками на конкретных примерах <p>Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5.</p>	Изучение учебной литературы. Подготовка к научной дискуссии, докладам и презентациям. Подготовка домашнего творческого задания.
Тема 4. Методология управления рисками в системе корпоративного управления	<ol style="list-style-type: none"> 1. Правовые (юридические) методы управления рисками в различных отраслях. 2. Специфика административных методов риск-менеджмента в различных отраслях. 3. Практика применения социальных и психологических методов управления рисками. 4. Практика применения производственных методов управления рисками. <p>Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5.</p>	Изучение учебной литературы. Подготовка к научной дискуссии, докладам и презентациям. Подготовка домашнего творческого задания.
Тема 5. Политика, стратегия и тактика управления рисками	<ol style="list-style-type: none"> 1. Практическое применение различных стратегий управления рисками (стратегия конкуренции, стратегия низких издержек, стратегия 	Изучение учебной литературы. Подготовка к научной дискуссии,

	<p>дифференциации, стратегия оптимальных издержек).</p> <p>2. Практика реализации политики стимулирования прибыли в ходе реализации проектов с высокой степенью риска в различных отраслях экономики.</p> <p>3. Практика использования компаниями оперативных и резервных ресурсов при тактическом управлении рисками.</p> <p>Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5.</p>	<p>докладам и презентациям.</p> <p>Подготовка домашнего творческого задания.</p>
Тема 6. Внешние риски и методы управления ими	<p>1. Практика учета политических рисков в деятельности организаций по отраслям.</p> <p>2. Практика управления природными рисками: затраты и результаты.</p> <p>Национальные риски в деятельности организаций, ведущих внешнеэкономическую деятельность.</p> <p>3. Практика управления экологическими рисками в зависимости от отрасли экономики: затраты и результаты, эффективность.</p> <p>4. Практика риск-менеджмента в отношении криминогенных рисков.</p> <p>5. Специфика практического управления логистическими рисками.</p> <p>6. Отраслевые и структурные риски: история и текущая ситуация.</p> <p>Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5.</p>	<p>Изучение учебной литературы. Подготовка к научной дискуссии, докладом и презентациям.</p> <p>Подготовка домашнего творческого задания.</p>
Тема 7. Управление внутренними административными рисками	<p>1. Управленческие дисфункции как причина возникновения внутренних рисков на примере конкретных компаний.</p> <p>2. Инструментарий риск-менеджмента в отношении организационных рисков.</p> <p>3. Проблемы выбора инструментария управления коммуникативными рисками.</p> <p>4. Специфика возникновения и развития информационных рисков.</p> <p>Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5.</p>	<p>Изучение учебной литературы. Подготовка к научной дискуссии, докладом и презентациям.</p> <p>Подготовка реферата.</p>
Тема 8. Специфика оценки и управления риском в бизнесе в условиях современных экономических преобразований	<p>1. Специфика определения полезности информации и ее достоверности в условиях современной экономики.</p> <p>2. Состав и последовательность работ по идентификации и ранжированию рисков в условиях современной экономики.</p> <p>3. Особенности идентификации и картографирования рисков для российских и зарубежных компаний.</p> <p>4. Специфика риск-менеджмента в производственном и торговом бизнесе.</p> <p>5. Практика применения количественных методов оценки рисков: вероятностно-статистические методы, методы экспертных оценок.</p> <p>6. Кривая Лоренца как метод оценки рисков. Метод VAR оценки риска. Стресс-тестирование и бэк-тестирование.</p> <p>Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5.</p>	<p>Изучение учебной литературы. Подготовка к научной дискуссии, докладом и презентациям.</p> <p>Подготовка реферата.</p>
Тема 9. Риск-ориентированный	<p>1. Специфика бюджетирования в компании. Система операционных бюджетов компании: специфика по</p>	<p>Изучение учебной литературы. Подготовка</p>

подход в управлении Корпоративными финансами	отраслям. 2. Особенности ценообразования в производственной сфере и торговой сфере. 3. Практика управления риском в ценообразовании компаний по отраслям. Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5.	к научной дискуссии, докладам и презентациям. Подготовка реферата.
Тема 10. Специфика инвестиционных рисков в корпоративном управлении	1. Сущность и составные компоненты инвестиционного проекта. 2. Понятие портфеля инвестиционных проектов. Специфика формирования портфеля инвестиционных проектов. 3. Практика оценки риска инвестиционного проекта. 4. Интегральные показатели эффективности инвестиционного проекта. 5. Оценка эффективности проекта в целом. Оценка участия в проекте. Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5.	Изучение учебной литературы. Подготовка к научной дискуссии, докладам и презентациям. Подготовка реферата.
Тема 11. Риск-ориентированный подход в антикризисном управлении	1. Понятие риска банкротства. Варианты оценки риска банкротства. 2. Специфика управления риском банкротства по отраслям. 3. Оптимизация плана внешнего управления. 4. Обзор моделей оценки кредитного риска. Корпоративные стандарты кредитной политики на основе внутренних кредитных рейтингов контрагентов: практика применения. 5. Практика экспертной оценки волатильности активов фирмы. 6. Практика расчета вероятности дефолта и распределения убытков с использованием структурных моделей для отдельных компаний. 7. Практика применения агрегированного подхода к расчету рыночного и кредитного рисков. 8. Модель Мертона. Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5.	Изучение учебной литературы. Подготовка к научной дискуссии, докладам и презентациям. Подготовка реферата.
Тема 12. Информационные технологии в управлении рисками	1. Слияния и поглощения: теория и реалии. Практика слияний и поглощений. 2. Практика применения различных организационных структур риск-менеджмента компаний: общее и особенное в зависимости от отраслей экономики. 3. Особенности бюджетирования системы управления рисками в условиях российской экономики и в зарубежных странах. Рекомендованные источники: основная литература 1, дополнительная литература 1-5.	Изучение учебной литературы. Подготовка к научной дискуссии, докладам и презентациям. Подготовка реферата.

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

Примерные вопросы для научных дискуссий, докладов и презентаций

1. Выбор инвестиционного портфеля в условиях неопределенности и риска.
2. Предпосылки и факторы, предшествующие наступлению рискованных ситуаций.
3. Методы уклонения от риска и его компенсации.
4. Методы управления финансовым риском.

5. Классификация рисков: различные подходы.
6. Роль Банка России в управлении банковскими рисками.
7. Способы снижения процентного и кредитного риска компании.
8. Понятие и классификация рисков в страховом бизнесе.
9. Концепция рисковой стоимости (Value at risk – VAR).
10. Организация управления риском на производственном предприятии.
11. Метод статистических испытаний (Monte-Carlo simulation).
12. Хеджирование рисков.
13. Управление кредитным риском в деятельности банков.
14. Статистические методы оценки риска.
15. Риски в международной банковской деятельности.
16. Аутсорсинг управления риском.
17. Методы финансирования рисков.
18. Пороговые значения риска.
19. Общая характеристика информации, необходимой для управления риском.
20. Идентификация и анализ рисков.

Примерная тематика домашних творческих заданий

1. Возможности достижения стратегических целей компании в условиях риск-ориентированного подхода.
2. Стратегия и политика управления рисками компании.
3. Цикл управления рисками компании.
4. Составление карты рисков на основе составленного регистра рисков.
5. Взаимосвязь внутреннего контроля и управления рисками.
6. Формирование отчетности по управлению рисками.
7. Мониторинг эффективности управления рисками.
8. Мероприятия по управлению рисками.
9. Контроль эффективности реагирования на риск.
10. Оценка рисков. Анализ «аппетита» на риск в условиях риск-ориентированного подхода.
11. Методы расчета уровня толерантности к рискам.
12. Качественная оценка рисков.
13. Количественное измерение рисков.
14. Анализ инвестиционной ситуации в условиях риск-ориентированного подхода.
15. Принятие решений по инвестиционным проектам в условиях риск-ориентированного подхода в корпоративном управлении.

Примерная тематика рефератов

1. Меры по предотвращению неплатежеспособности и несостоятельности российских предприятий.
2. Реструктуризация предприятия: подходы и решения.
3. Правовое регулирование отношений в сфере несостоятельности (банкротства).
4. Анализ результатов развития предприятия в условиях быстро меняющейся внешней среды.
5. Пути реструктуризации предприятия с учетом зарубежного опыта.
6. Диагностика банкротства предприятий: теория и практика.
7. Основные стратегии вывода предприятия из кризиса.
8. Классификация антикризисных стратегий.
9. Меры по восстановлению платежеспособности должника.
10. Выбор оптимального объема производства в условиях неопределенности спроса.
11. Методы оценки эффективности инвестиционных проектов.

12. Расчет эффективности проекта по методу NPV в условиях риск-ориентированного подхода.

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

Перечень контрольных вопросов к экзамену

1. Дайте определение понятий риска, неопределенности.
2. Охарактеризуйте методы, используемые в риск-менеджменте.
3. Назовите внутренние и внешние факторы, влияющие на уровень риска.
4. Каким образом можно классифицировать риски? Назовите основные классы рисков.
5. Идентификация и анализ рисков.
6. Анализ и оценка уровня риска.
7. Качественные и количественные методы оценки риска.
8. Количественные характеристики риска в ходе его оценки.
9. Статистические методы оценки риска.
10. Абсолютные и относительные показатели оценки риска.
11. Цели и задачи управления риском.
12. Процесс управления рисками на предприятии.
13. Основные способы воздействия на риск.
14. Экспертные методы оценки риска.
15. Роль страхования в системе риск-менеджмента.
16. Содержание страхования как метода управления риском.
17. Понятие и классификация рисков в страховом бизнесе.
18. Управление рисками в страховых компаниях.
19. Каковы функции риск-менеджера в системе корпоративного управления.
20. Виды инвестиционных рисков.
21. Методы оценки рисков инвестиционных проектов.
22. Кредитные риски и их характеристика.
23. Процентные риски и их виды.
24. Способы снижения процентного и кредитного риска. Управление кредитным риском в деятельности банков.
25. Риски в международной банковской деятельности.
26. Характеристика коммерческих и финансовых рисков.
27. Методы управления финансовым риском.
28. Интегральные характеристики риска и их использование при принятии решения при реализации риск-ориентированного подхода.
29. Оценка эффективности различных методов управления риском.
30. Выбор инвестиционного портфеля в условиях неопределенности и риска.
31. Методы оценки привлекательности инвестиционного проекта.
32. Предпосылки и факторы, предшествующие наступлению рискованных ситуаций.
33. Методы уклонения и компенсации риска.
34. Концепция рисковой стоимости (Value at risk – VAR).
35. Метод статистических испытаний (Monte-Carlo Simulation).
36. Применение теории математических игр в риск-менеджменте.
37. Хеджирование рисков.
38. Диагностика банкротства предприятий.
39. Основные стратегии вывода предприятия из кризиса.
40. Классификация антикризисных стратегий.
41. Меры по восстановлению платежности должника.
42. Управление рисками в сфере торговли.
43. Управление рисками, возникающими при лизинговом инвестировании.

44. Управление производственными рисками на предприятии.
45. Математические методы рискового моделирования.
46. История возникновения риск-менеджмента.
47. Хронология исследований риска.

Пример экзаменационного билета

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

Кафедра «Экономика, финансы и менеджмент»

Дисциплина «Риск-ориентированный подход в системе корпоративного управления»

Форма обучения очная

Семестр 6,7

Направление 38.03.01 «Экономика» Профиль «Анализ и управление рисками организации»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 1

- 1 вопрос (15 баллов) Методы оценки рисков инвестиционных проектов.
- 2 вопрос (15 баллов) Концепция рисковой стоимости (Value at risk – VAR).
3. Задание (30 баллов). Опишите специфику выбора инвестиционного портфеля в условиях неопределенности и риска.

Подготовил: _____ (Заболотняя Е.А.)

Утверждаю:

Зав. кафедрой _____ (Четошникова Л.А.)

Дата «__» _____ 20__ г.

Примеры оценочных средств для проверки каждой компетенции, формируемой дисциплиной

Компетенция	Индикаторы достижения компетенций	Типовые задания
ПКП-3 Способность поддержания устойчивого функционирования системы управления рисками	1. Соблюдает и поддерживает нормы профессиональной этики, нормы корпоративного управления и корпоративной культуры по рискам.	Задание 1. Опишите историю возникновения риск-менеджмента. Вопрос 1. Какие факторы предшествуют наступлению рисковых ситуаций?
	2. Устанавливает и поддерживает деловые контакты, связи, отношения и коммуникации с сотрудниками компании, проводит интервью с ответственными за риск сотрудниками.	Вопрос 1. Каковы интегральные характеристики риска и в чем специфика их использования при принятии решения при реализации риск-ориентированного подхода? Вопрос 2. Каковы функции риск-менеджера в системе корпоративного управления?
	3. Оказывает помощь сотрудникам в выявлении и оценке новых рисков, представляет аналитическую информацию о рисках для руководителей и ответственных за мероприятия по	Вопрос 1. Как осуществляется оценка эффективности различных методов управления риском? Вопрос 2. Каким образом можно классифицировать риски? Назовите основные классы рисков.

	рискам работников	Вопрос 3. Какие методы используются для оценки привлекательности инвестиционного проекта.
ПКП-4 Способность разрабатывать системы управления рисками в рамках отдельных бизнес-процессов, направлений, методическую и нормативную базу по обеспечению ее функционирования	1. Применяет основные положения международных стандартов по риск-менеджменту и смежным вопросам при разработке корпоративных нормативных актов по управлению рисками в организации и системы управления рисками.	Задание 1. Перечислите и охарактеризуйте основные стратегии вывода предприятия из кризиса. Вопрос 1. Какова классификация антикризисных стратегий? Вопрос 2. Какие математические методы рискового моделирования Вы знаете?
	2. Разрабатывает методическую документацию по управлению рисками с целью организации процесса управления рисками в организации с учетом отраслевых стандартов и принятой в организации классификацией рисков.	Вопрос 1. Как происходит хеджирование рисков в зависимости от отраслей экономики и видов риска? Вопрос 2. Какова специфика управления рисками в страховых компаниях?
	3. Осуществляет мониторинг системы управления рисками, актуализацию карт рисков по бизнес-процессам, направлениям бизнеса.	Вопрос 1. Каков алгоритм диагностики банкротства предприятий? Вопрос 2. Каковы абсолютные и относительные показатели оценки риска? Вопрос 3. Какова специфика кредитных рисков?

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

Нормативно-правовые акты:

- ГОСТ Р ИСО 31000-2010 «Менеджмент риска. Принципы и руководство»
- ГОСТ Р ИСО 73:2009 «Менеджмент риска. Словарь. Руководство по использованию в стандартах»
- ГОСТ Р ИСО/МЭК 31010:2009 «Менеджмент риска. Методы оценки риска»
- МСА 400 «Оценка рисков и внутренний контроль»
- Федеральный закон «О несостоятельности (банкротстве)» [Электронный ресурс]: федеральн. закон от 26.10.2002 № 127-ФЗ (с изм. и доп.) // Справочная система «Гарант»
- Федеральный закон «Об аудиторской деятельности» [Электронный ресурс]: федеральн. закон от 30.12.2008 № 307-ФЗ (с изм. и доп.) // Справочная система «Гарант»

Основная литература:

- Буянский, С.Г. Корпоративное управление, комплаенс и риск-менеджмент: учебное пособие / Буянский С.Г., Трунцевский Ю.В. — Москва: Русайнс, 2020. — 342 с. — ISBN 978-5-4365-0813-9. — Текст: электронный // ЭБС BOOK.ru - URL: <https://book.ru/book/934712>. — Режим доступа: по подписке.

Дополнительная литература:

- Авдийский, В. И. Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов: учеб. пособие / В.И. Авдийский, В.М. Безденежных, А.В. Дадалко, В.В. Земсков, Н.Г. Синявский; под общ. ред. А.В. Дадалко. — Москва: ИНФРА-М, 2019. — 203 с. - ISBN

978-5-16-012236-6. - Текст: электронный//ЭБС ZNANIUM.com - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1024505>. – Режим доступа: по подписке.

2. Авдийский, В. И. Риски хозяйствующих субъектов: теоретические основы, методологии анализа, прогнозирования и упр.: Уч. пос. / В.И. Авдийский, В.М. Безденежных. - Москва: Альфа-М: НИЦ ИНФРА-М, 2013 - 368 с. - ISBN 978-5-98281-333-6. - Текст: электронный // ЭБС ZNANIUM.com. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/394136>. – Режим доступа: по подписке.

3. Антонов, Г. Д. Управление рисками организации: учебник / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. — Москва: ИНФРА-М, 2020. — 153 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). — DOI 10.12737/6216. - ISBN 978-5-16-013060-6. - Текст: электронный // ЭБС ZNANIUM.com. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1052461>. – Режим доступа: по подписке.

4. Воробьев, С. Н. Управление рисками в предпринимательстве [Электронный ресурс] / С. Н. Воробьев, К. В. Балдин. - 4-е изд., испр. - Москва: Издательско-торговая корпорация «Дашков и Ко», 2013. - 482 с. - ISBN 978-5-394-01987-6. - Текст: электронный// ЭБС ZNANIUM.com. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/430664>. – Режим доступа: по подписке.

5. Касьяненко, Т.Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе: учебник и практикум для вузов / Т.Г. Касьяненко, Г.А. Маховикова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2020. — 381 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00375-8. — Текст: электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/450126>. – Режим доступа: по подписке.

9. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины:

1. Единое окно доступа к образовательным ресурсам – <http://window.edu.ru/>
2. Научная электронная библиотека eLibrary.ru – <http://elibrary.ru>
3. Сайт Банка России – www.cbr.ru
4. Сайт Ведомости – www.vedomosti.ru
5. Сайт Интерфакс – www.interfax.ru
6. Сайт Коммерсантъ – www.kommersant.ru
7. Сайт КонсультантПлюс – www.consultant.ru
8. Сайт Международной ассоциации комплаенса – www.Int-comp.org/careers/a-career-in-compliance
9. Сайт Министерства Финансов РФ. – www.minfin.ru
10. Сайт РосБизнесКонсалтинг – www.rbc.ru
11. Федеральный портал «Российское образование» <http://www.edu.ru/>
12. Федеральный центр информационно-образовательных ресурсов <http://fcior.edu.ru/>
13. Электронная библиотека Финансового университета (ЭБ) <http://elib.fa.ru/>
14. Электронно-библиотечная система «Университетская библиотека ОНЛАЙН» <http://biblioclub.ru/>
15. Электронно-библиотечная система издательства «ЮРАЙТ» <https://www.biblio-online.ru/>
16. Электронно-библиотечная система BOOK.RU <http://www.book.ru>
17. Электронно-библиотечная система Znaniium <http://www.znaniium.com>

10. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Основными видами самостоятельной учебной деятельности обучающихся по освоению дисциплины являются:

1) Предварительная подготовка к аудиторным занятиям (лекциям, семинарам, практическим занятиям). Такая подготовка предполагает изучение учебной программы дисциплины, установление связи с ранее полученными знаниями, выделение наиболее значимых и актуальных проблем, на изучение которых следует обратить особое внимание, подготовку сообщений и докладов по темам семинаров учебной дисциплины;

2) Самостоятельная работа при прослушивании лекций, осмысление учебной информации, сообщаемой преподавателем, ее обобщение и краткая запись, а также своевременная доработка конспектов лекций;

3) Подбор, изучение, анализ рекомендованных информационных источников по темам учебной дисциплины;

4) Выяснение наиболее сложных вопросов и их уточнение во время консультаций;

5) Подготовка к экзамену.

6) Выполнение собственных научных исследований, участие в научных исследованиях, проводимых в масштабе кафедры, филиала или университета;

7) Систематическое изучение периодической печати, научных монографий, поиск и анализ дополнительной информации по учебной дисциплине.

Выполнение **самостоятельных домашних заданий** предполагают подготовку доклада, презентации для занятий, приводящихся в форме дискуссий, изучение материала для семинарских занятий и подбор материала для решения практических заданий. Самостоятельная работа по освоению дисциплины заключается в изучении и конспектировании дополнительной литературы, изучении законодательных и нормативных актов, выполнении заданий по исходным данным, предложенным преподавателем. Результаты самостоятельной работы оформляются в виде презентации и обсуждаются на практических занятиях. Работа выполняется с использованием текстового редактора MS WORD, MS EXCEL – для таблиц, диаграмм и т.д., MS PowerPoint – для подготовки слайдов и презентаций.

При подготовке к семинарскому занятию используется лекционный материал. Он является основой для подготовки студента к семинарским занятиям и выполнения заданий самостоятельной работы. В соответствии с п.5.3 студентам необходимо осуществлять подготовку к семинарским занятиям. Быть готовыми к дискуссии, разбору конкретных ситуаций. При подготовке к семинарскому занятию студенты должны изучить и законспектировать содержание дополнительной литературы, статей, книг, включающие в себя основные положения и их обоснование фактами, примерами и т.д.

Подготовка к научной дискуссии осуществляется студентами самостоятельно, при наличии задания, выданного преподавателем.

Подготовка домашнего творческого задания, реферата осуществляется под методическим руководством преподавателя, ведущего семинарские занятия по дисциплине в соответствии с темами, представленными в п.6.2. Его оценка проводится в процессе текущего контроля успеваемости студентов.

Требования к выполнению:

- четкость и последовательность изложения материала;
- наличие обобщений и выводов, сделанных на основе изучения информационных источников по данной теме (в случае необходимости);
- правильность и в полном объеме решение имеющихся в задании практических задач;
- использование современных способов поиска, обработки и анализа информации;
- самостоятельность выполнения.

Объем работы - не более 6 страниц (без учета таблиц в приложении) машинописного текста (размер шрифта 14) через полуторный интервал на стандартных листах формата А-4, поля: верхнее –15 мм, нижнее –15мм, левое –25мм, правое –10мм. Домашнее творческое задание, реферат должен иметь титульный лист.

По вопросам, возникающим в процессе написания работы, студенту следует обращаться за консультацией преподавателю. Срок выполнения домашнего творческого задания, реферата определяется преподавателем. Задание, реферат сдается не позднее, чем за неделю до экзамена.

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 информационно-образовательную среду университета.

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