

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Андрей Драгомирович Хлутков  
Должность: директор  
Дата подписания: 02.12.2024 23:52:25  
Уникальный программный ключ:  
880f7c07c583b07b775f6604a630281b13ca9fd2

**Федеральное государственное бюджетное образовательное  
учреждение высшего образования  
«РОССИЙСКАЯ АКАДЕМИЯ НАРОДНОГО ХОЗЯЙСТВА И ГОСУДАРСТВЕННОЙ  
СЛУЖБЫ  
ПРИ ПРЕЗИДЕНТЕ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»  
СЕВЕРО-ЗАПАДНЫЙ ИНСТИТУТ УПРАВЛЕНИЯ – филиал РАНХиГС**

ФАКУЛЬТЕТ ЭКОНОМИКИ и ФИНАНСОВ  
(наименование структурного подразделения (института))

Кафедра менеджмента  
(наименование кафедры)

УТВЕРЖДЕНО

Директор Хлутков А.Д.

**ПРОГРАММА БАКАЛАВРИАТА  
«Стратегический менеджмент»**

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ,  
реализуемой без применения электронного (онлайн) курса  
Б1.В.ДВ.02.01 Риск-менеджмент  
(индекс, наименование дисциплины, в соответствии с учебным планом)**

**38.03.02 Менеджмент**  
(код, наименование направления подготовки)

Очная/очно-заочная  
(формы обучения)

Год набора – 2024

Год набора – 2024

**Автор(ы)–составитель(и):**

Директор департамента образовательной деятельности СЗИУ РАНХиГС, к.э.н., доцент,  
Шматко Анна Дмитриевна;

Старший преподаватель кафедры менеджмента, Черкасская Анна Юрьевна;

Директор образовательной программы «Менеджмент», к.э.н., доцент, доцент Кудряшов  
Вадим Сергеевич;

Заведующий кафедрой менеджмента, д.э.н., профессор Лабудин Александр Васильевич;

РПД Б1.В.ДВ.02.01 Управление рисками одобрена на заседании кафедры менеджмента.  
Протокол №7 от 11 апреля 2024 г.

## СОДЕРЖАНИЕ

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения программы.....	4
2. Объем и место дисциплины в структуре ОП .....	5
3. Содержание и структура дисциплины .....	6
4. Материалы текущего контроля успеваемости .....	9
4.2. Типовые материалы текущего контроля успеваемости обучающихся.....	9
5. Оценочные материалы промежуточной аттестации по дисциплине .....	15
6. Методические материалы по освоению дисциплины .....	19
7. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» .....	21
7.1. Основная литература .....	21
7.2. Дополнительная литература .....	23
7.3. Нормативные правовые документы .....	22
7.4. Интернет-ресурсы .....	22
8. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы.....	23

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

1.1. Дисциплина **Б1.В.ДВ.02.01 Риск-менеджмент** обеспечивает овладение следующими компетенциями с учетом этапа:

*Таблица 1*

<b>Код компетенции</b>	<b>Наименование компетенции</b>	<b>Код компонента компетенции</b>	<b>Наименование компонента компетенции</b>
ПКс-4	Способен осуществлять поэтапный контроль реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений, договоров и контрактов и координировать деятельность исполнителей с помощью методического инструментария реализации управленческих решений в области функционального менеджмента для достижения высокой согласованности при выполнении конкретных проектов и работ	ПКс-4.2	Способен координировать деятельность исполнителей с помощью методического инструментария реализации управленческих решений

1.2. В результате освоения дисциплины у студентов должны быть сформированы:

*Таблица 2*

<b>ОТФ/ТФ (при наличии профстандарта) / трудовые или профессиональные действия</b>	<b>Код компонента компетенции</b>	<b>Результаты обучения</b>
В/03.6 Оказание методической помощи и поддержка процесса управления рисками для ответственных за риск сотрудников организации - владельцев риска	ПКс-4.2	<p><u>На уровне знаний:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- основы бизнес-планирования, методики контроля и реализации бизнес-планов, знать базовые условия заключаемых соглашений, договоров и контрактов,</li> <li>- знать методический инструментарий реализации управленческих решений в области функционального менеджмента для достижения высокой согласованности при выполнении конкретных проектов и работ.</li> </ul> <p><u>На уровне умений:</u></p>

		<p>- поэтапно контролировать реализацию бизнес-планов и условий заключаемых соглашений, договоров и контрактов, координировать деятельность исполнителей с помощью методического инструментария реализации управленческих решений в области функционального менеджмента для достижения высокой согласованности при выполнении конкретных проектов и работ.</p> <p><u>На уровне навыков:</u></p> <p>- навыками поэтапного контроля реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений, договоров и контрактов, умением координировать деятельность исполнителей с помощью методического инструментария реализации управленческих решений в области функционального менеджмента для достижения высокой согласованности при выполнении конкретных проектов и работ</p>
--	--	--

## 2. Объем и место дисциплины в структуре ОП

Таблица 3

Вид работы	Трудоемкость (в академ. часах / в астрономич. часах)
<i>Очная форма</i>	
<b>Общая трудоемкость</b>	108/81
<b>Контактная работа с преподавателем</b>	58/43,5
Лекции	26/19,5
Практические занятия	32/24
Лабораторные занятия	-
<b>Практическая подготовка</b>	8
<b>Самостоятельная работа</b>	50/37,5
Формы текущего контроля	Тестирование, дискуссия
<b>Форма промежуточной аттестации</b>	Зачет
<i>Очно-заочная форма</i>	
<b>Общая трудоемкость</b>	108/81
<b>Контактная работа с преподавателем</b>	32/24
Лекции	16/12
Практические занятия	16/12
Лабораторные занятия	-
<b>Практическая подготовка</b>	8
<b>Самостоятельная работа</b>	76/57
Формы текущего контроля	Тестирование, дискуссия
<b>Форма промежуточной аттестации</b>	Зачет

Дисциплина реализуется частично с применением дистанционных образовательных технологий (далее – ДОТ).

## Место дисциплины в структуре ОП ВО

Учебная дисциплина Б1.В.ДВ.02.01 Риск-менеджмент относится к дисциплинам по выбору вариативной части Блока 1 «Дисциплины». Дисциплина читается на 4 курсе в 8 семестре по очной форме обучения и на 5 курсе в 9 семестре по очно-заочной форме обучения. Учебная дисциплина базируется на знаниях, полученных на дисциплинах: Теория организации, Экономика и управление организацией. Знания, полученные в результате освоения дисциплины Б1.В.ДВ.02.01 Риск-менеджмент, используются студентами при изучении дисциплины, могут использоваться при прохождении обучающимися практики по получению первичных профессиональных умений и навыков. Формы промежуточной аттестации в соответствии с учебным планом – зачет.

Доступ к системе дистанционных образовательных технологий осуществляется каждым обучающимся самостоятельно с любого устройства, и том числе на портале: <https://lms.ranepa.ru/>. Пароль и логин к личному кабинету / профилю предоставляется студенту в деканате.

### 3. Содержание и структура дисциплины

#### 3.1. Структура дисциплины

*Таблица 3*

##### *Очная форма обучения*

№ п/п	Наименование тем (разделов),	Объем дисциплины, час.					Форма текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации	
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий					
			Л/ДОТ	ЛР/ДОТ	ПЗ/ДОТ	КСР		
Тема 1	Основные этапы развития риск-менеджмента. Фрактальная модель организации.	21	5		6		10	Д**
Тема 2	Риск как объект диагностики и оценки. Управленческий механизм риск-менеджмента.	21	5		6		10	Д**
Тема 3	Человеческий и финансовый аспект управления рисками.	21	5		6		10	Д**
Тема 4	Инструменты риск-менеджера.	22	5		7		10	Т*
Тема 5	Стандартизация в риск-менеджменте.	23	6		7		10	Д**
Промежуточная аттестация								Зачет
<b>Всего акад./астрон. часов:</b>		108/81	26		32		50	

Используемые сокращения:

Л – занятия лекционного типа (лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся) ;

ЛР – лабораторные работы (вид занятий семинарского типа) ;

ПЗ – практические занятия (виды занятий семинарского типа за исключением лабораторных работ) ;

КСР – индивидуальная работа обучающихся с педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях (в том числе индивидуальные консультации) ;

ДОТ – занятия, проводимые с применением дистанционных образовательных технологий, в том числе с применением виртуальных аналогов профессиональной деятельности.

СР – самостоятельная работа, осуществляемая без участия педагогических работников организации и (или) лиц, привлекаемых организацией к реализации образовательных программ на иных условиях.

Т\* – тестирование

Д\*\* - дискуссия

Таблица 4

**Очно-заочная форма обучения**

№ п/п	Наименование тем (разделов),	Объем дисциплины, час.					СР	Форма текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий					
			Л/ ДОТ	ЛР/ ДОТ	ПЗ/ ДОТ	КСР		
Тема 1	Основные этапы развития риск-менеджмента. Фрактальная модель организации.	24	4		4		16	Д, О, К**
Тема 2	Риск как объект диагностики и оценки. Управленческий механизм риск-менеджмента.	20	2		2		16	Д, О, К**
Тема 3	Человеческий и финансовый аспект управления рисками.	22	4		4		14	Д, О, К**
Тема 4	Инструменты риск-менеджера.	20	2		2		16	Т, Д, О, К*
Тема 5	Стандартизация в риск-менеджменте.	22	4		4		14	Д, О, К**
Промежуточная аттестация								Зачет
<b>Всего акад./астрон. часов :</b>		108/81	16		16		76	

Используемые сокращения:

Л – занятия лекционного типа (лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся) ;

ЛР – лабораторные работы (вид занятий семинарского типа) ;

ПЗ – практические занятия (виды занятий семинарского типа за исключением лабораторных работ) ;

КСР – индивидуальная работа обучающихся с педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях (в том числе индивидуальные консультации) ;

ДОТ – занятия, проводимые с применением дистанционных образовательных технологий, в том числе с применением виртуальных аналогов профессиональной деятельности.

СР – самостоятельная работа, осуществляемая без участия педагогических работников организации и (или) лиц, привлекаемых организацией к реализации образовательных программ на иных условиях.

*Т – тестирование*

*Д – дискуссия*

*О – опрос*

*К – кейс*

### **3.2. Содержание дисциплины**

#### **Тема 1. Основные этапы развития риск-менеджмента. Фрактальная модель организации.**

Краткая история «борьбы с богами» и современный риск-менеджмент. О фрактальном подходе. Целостная модель организации. Ценности и экспозиции. Фрактальная модель организации и ее рискового ландшафта. Чем и ради чего: смысл и ситуации рискования. Что может дать хороший целостный риск-менеджмент. Рисковый ландшафт и рисковые характеристики организации. Многоликий феномен риска. Аспекты риска, потерь и benefits. Целостное управление рисками — парадигма упреждающего управления.

#### **Тема 2. Риск как объект диагностики и оценки. Управленческий механизм риск-менеджмента.**

Основы управленческой диагностики рисков. Формула риска. Преобразование базовой продвинутой формулы риска. Таксономия рисков. Пирамида риска: факторы, симптомы, бифуркации, контроль. Риск как объект диагностики и оценки. Модель функции риск-менеджмента в управлении фирмой. Распределение обязанностей по управлению рисками: карты распределения ответственности. Защита от стратегических рисков. Подпрограмма защиты непрерывности бизнеса. Рутинный риск-менеджмент. Чрезвычайная ситуация. Управленческий механизм риск-менеджмента.

#### **Тема 3. Человеческий и финансовый аспект управления рисками.**

Индивидуальное и групповое поведение людей и управление рисками. Психологические особенности реакции на риск. Риски работы с кадрами. Оценка рискового аппетита сотрудников. Оценка потребного и фактического аппетита рискованной позиции. Зеленый офис экономит не только ресурсы и деньги, но и нервы. Человеческий аспект управления рисками. Риск, доходность и стоимость фирмы. Методы финансирования программы

управления риском. Финансовые инструменты управления рисками. Финансовый аспект управления рисками.

#### **Тема 4. Инструменты риск-менеджера.**

Методический арсенал диагностики. Инструментарий управления рисками. Методики оценки политических рисков. Когда требуется внешний консультант в сфере управления рисками. Инструментальный ящик риск-менеджера.

#### **Тема 5. Стандартизация в риск-менеджменте.**

Стандартизация в риск-менеджменте. Правила обращения с рисками.

### **4. Материалы текущего контроля успеваемости**

**4.1.** В ходе реализации дисциплины Б1.В.ДВ.02.01 Риск-менеджмент используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

при проведении занятий лекционного типа: контрольная работа, опрос на практическом занятии.

при проведении занятий семинарского типа: контрольная работа, опрос на практическом занятии.

при контроле результатов самостоятельной работы студентов: контрольная работа, опрос на практическом занятии.

*Таблица 5*

<i>Тема и/или раздел</i>	<i>Методы текущего контроля успеваемости</i>
1. Основные этапы развития риск-менеджмента. Фрактальная модель организации.	Д, О, К
2. Риск как объект диагностики и оценки. Управленческий механизм риск-менеджмента.	Д, О, К
3. Человеческий и финансовый аспект управления рисками.	Д, О, К
4. Инструменты риск-менеджера.	Д, О, К,
5. Стандартизация в риск-менеджменте.	Д, О, К

#### **4.2. Типовые материалы текущего контроля успеваемости обучающихся.**

Типовые оценочные материалы по теме 1

Контрольные и аналитические вопросы для опроса:

1. Что дало основание П. Бернстайну назвать риск-менеджмент «борьбой с богами»?
2. В чем различие между общим риск-менеджментом и финансовым?
3. Как давно возник в человеческой практике риск-менеджмент?
4. Когда и почему возникла профессия «риск-менеджмент»?
5. Каков прогноз развития профессии «риск-менеджмент»?
6. Что вызвало ускорение развития теории и практики риск-менеджмента во второй половине XX в.?
7. Почему хорошее управление рисками следует считать конкурентным преимуществом коммерческой организации?
8. Зачем необходим фрактальный подход к управлению организацией и ее рисками?

9. Что такое структурный фрактал организации и для чего он нужен?
10. Что такое процессный фрактал организации и для чего он нужен?
11. Что такое рисковый ландшафт организации?
12. Что такое фатальный (сокрушительный) риск
13. Чем может отличаться организационная структура реальной организации от ее идеальных фракталов?
14. С чего следует начинать анализ рискового ландшафта реальной организации?
15. Как можно применять типовые списки рисков при заполнении рискового ландшафта реальной организации?
16. Какими переменами возможно управлять при имеющихся ресурсах, т.е. вложения в какие риски не менее выгодны, чем другие направления инвестирования?
17. Как защитится от рисков, связанных с переменами, которыми следовало бы управлять, да у самой организации на это не хватает сил?
18. Какие общие резервы необходимы организации для предотвращения последствий ошибок и преобразования перемен, которыми, как казалось, не нужно управлять, в те, которыми, как выяснилось, управлять необходимо?
19. Что такое матрица БКГ?
20. Для чего ее можно применить в системе управления рисками?
21. Может ли один и тот же риск оцененным по-разному с разных точек зрения стейкхолдеров организации?
22. Может ли один и тот же риск оцененным по-разному в разных аспектах?
23. В чем состоит юридический аспект риска?
24. Чем отличается экономический аспект риска от финансового?
25. В каких направлениях следует вести исследования, чтобы выявить новые опасности и новые возможности, а в чем следует просто положиться на благорасположение Господа?
26. Как защититься от рисков, которыми нужно бы управлять, но у самой организации на это не хватает сил?
27. Что опаснее: лететь из Москвы в Санкт-Петербург на самолете или ехать на автомобиле?

#### Типовые оценочные материалы по теме 2

Контрольные и аналитические вопросы для опроса:

1. Для чего необходима классификация рисков фирмы?
2. По каким параметрам оценивается риск по концепции Арнольда?
3. В чем недостатки двухкомпонентной оценке риска?
4. Что такое «треугольник риска» и «пирамида риска»?
5. Что такое синергия в риск-менеджменте?
6. Сколько существует видов неопределенности в деятельности фирмы?
7. Что такое «управленческая диагностика рисков фирмы»?
8. К каким видам рисков бизнеса может применяться теория вероятности?
9. Что такое ситуационный план управления в чрезвычайной ситуации?
10. Из каких блоков состоит система целостного управления рисками фирмы?
11. Все ли риски фирмы целесообразно страховать?
12. Все ли риски фирмы поддаются страхованию?
13. Когда следует обращаться к внешним консультантам по риск-менеджменту?
14. Для чего необходима система государственного регулирования деятельности страховых фирм?

#### Типовые оценочные материалы по теме 3

Контрольные и аналитические вопросы для опроса:

1. Как отличается поведение людей по отношению к принятию рисков в одиночестве и в группе?
2. Необходимо ли учитывать тип рисков поведения человека при назначении на должность?
3. Существуют ли различия в отношении к риску у людей разного пола?
4. Существуют ли различия в отношении к риску у руководителей разных стран?
5. Существует ли законченная теория поведения людей в условиях риска?
6. Изменяется ли отношение человека к риску с возрастом?
7. Изменяется ли отношение человека к риску в связи с изменением социального статуса и повышением принимаемой на себя ответственности?
8. Как изменяется отношение к риску в организации на разных этапах ее жизненного цикла?
9. Какова зависимость между рискованным поведением и доходностью фирмы?
10. Как влияет оценка состояния риск-менеджмента в фирме на ее рыночную стоимость?
11. Какие аспекты следует учитывать при оценке финансовой устойчивости фирмы?
12. Каковы источники финансирования риск-менеджмента в коммерческой организации?
13. Как связаны финансовые и операционные риски фирмы?
14. Как связаны финансовые риски и корпоративная культура организации?

#### Типовые оценочные материалы по теме 4

##### Контрольные и аналитические вопросы для опроса:

1. Для чего была создана базельская система?
2. Из каких частей состоит базельская система?
3. Какие риски покрывают методики базельской системы?
4. Каковы три опоры базельской системы?
5. Какое отношение имеет базельская система к небанковским коммерческим организациям?
6. Следует ли ожидать в ближайшем будущем завершения деятельности Базельского комитета?
7. Каковы три главных инструмента риск-менеджера?
8. Все ли риски можно устранить?
9. Существует ли стандарт, определяющий все инструменты риск-менеджера?
10. Можно ли перечислить все существующие методы управления рисками фирмы?
11. Какие инструменты управления рисками следует применять в первую очередь?
12. Для применения каких методов всегда следует приглашать внешних консультантов?
13. В какой мере методики управления рисками, разработанные за рубежом, подходят к реалиям российской экономики?

#### Типовые оценочные материалы по теме 5

##### Контрольные и аналитические вопросы для опроса:

1. Какая страна первой разработала национальный стандарт по управлению рисками?
2. Существует ли национальный стандарт управления рисками в России?
3. Почему работу по риск-менеджменту в коммерческих организациях ведущие страны мира стремятся стандартизировать?
4. Можно ли полностью стандартизировать деятельность по управлению рисками на основе единого стандарта?
5. Какие страны лидируют в сфере стандартизации риск-менеджмента?
6. Что такое *COSO*?

7. Существует ли единый, обязательный для всех стран стандарт управления рисками фирмы, работающей на международном рынке?
8. Возможно ли защититься от всех видов рисков, если нет ограничений на финансирование риск-менеджмента?
9. Состоит ли главная задача риск-менеджмента в уклонении от рисков или в чем-то другом?
10. Чья поддержка абсолютно необходима риск-менеджерам?
11. Какую часть организации необходимо защищать от рисков в первую очередь?
12. Какой подход наиболее эффективен в управлении рисками организации?
13. Кого следует обучать основам управления рисками в первую очередь?
14. Какого значения здорового смысла в управлении рисками?
15. Как связаны цели организации и ее риски?
16. В чем состоит эффективность риск-менеджмента в организации?
17. Какую роль играет контроль в управлении рисками организации?
18. Какова роль информации и знаний в обеспечении задач риск-менеджмента? Можно ли ограничиться страхованием стратегических рисков организации?

### **Кейсы и ситуационные задания**

#### Тема 1

- 1.1. Посмотрите в Интернете кинофильм «Чужие деньги», «Аполлон 13», «Неудержимый» и «Багровый прилив». Составьте односторонний меморандум о главных причинах реализации крупных рисков в этих ситуациях.
- 1.2. Составьте рисковый ландшафт для преобразуемой компании «Проволока и кабель Новой Англии» из кинофильма «Чужие деньги» на момент начала фильма.
- 1.3. Оцените риск финансового захвата фирмы компании «Проволока и кабель Новой Англии» на момент начала фильма.
- 1.4. Составьте рисковый ландшафт для преобразуемой компании «Проволока и кабель Новой Англии» из кинофильма «Чужие деньги» на момент окончания фильма.
- 1.5. Постройте трехуровневые фрактальные пирамиды для компании «Проволока и кабель Новой Англии» из кинофильма «Чужие деньги». Проанализируйте дефекты этих структур на момент появления в фирме финансового рейдера.
- 1.6. Постройте трехуровневые фрактальные пирамиды для системы управления атомной подводной лодкой из кинофильма «Багровый прилив». Проанализируйте дефекты этих структур, выявляющиеся во время конфликта при принятии решения.
- 1.7. Составьте по возможности полный список стейкхолдеров компании «Проволока и кабель Новой Англии» из кинофильма «Чужие деньги». Как изменяется влияние отдельных стейкхолдеров на различных этапах развития фирмы? Выделите трех наиболее влиятельных стейкхолдеров в начале проекта реконструкции компании после финансового захвата.
- 1.8. Составьте по возможности полный список стейкхолдеров для ситуации со срывом поезда в неуправляемое движение из кинофильма «Неудержимый». Как изменяется влияние отдельных стейкхолдеров на различных этапах движения поезда?
- 1.9. Подумайте над тем, с каких аспектов рассматривают ситуацию в компании «Проволока и кабель» участники конфликта во время недружественного финансового захвата фирмы. Возможно ли взаимопонимание между ними? Какие риски отражает каждая точка зрения?
- 1.10. Посмотрите фильм «Неудержимый», основанный на реальном случае из жизни. Этот фильм о том, как грузовой железнодорожный эшелон сорвался с тормозов и понесся с нарастающей скоростью в окружении жилых районов, грозя сойти с рельсов в любой момент. Поезд в итоге остановил герой-машинист.

Представьте себе, что вы главный риск-менеджер железнодорожной компании, которой принадлежит этот поезд. Ваша задача - написать аналитический отчет руководству об этом случае. Какие аспекты рисков вы затронете в этом отчете, цель которого - принятие мер по недопущению аналогичных случаев в будущем?

## Тема 2

- 2.1. Как бы вы определили главные риски промышленной, железнодорожной и военной организации из кинофильмов «Чужие деньги», «Неудержимый» и «Багровый прилив» соответственно? Что нужно изменить в системе управления, чтобы избежать этого в будущем?
- 2.2. Разработайте Меморандум о намерениях по устранению недостатков, вызывающих главные риски в п. 2.1.
- 2.3. Недружественный финансовый захват для работающей фирмы — это ЧП. Какой план действий вы бы предложили компании «Проволока и кабель Новой Англии» из фильма «Чужие деньги» на этот случай?
- 2.4. Какие дополнительные инструкции требуется разработать для командования атомной подводной лодкой в чрезвычайных ситуациях утраты согласованности управления в кинофильме «Багровый прилив»?
- 2.5. Какая система риск-менеджмента нужна для компании «Проволока и кабель Новой Англии» на новом этапе ее жизни? Составьте меморандум о намерениях по созданию такой системы?

## Тема 3

- 3.1. Охарактеризуйте влияние корпоративной культуры компании «Проволока и кабель» из кинофильма «Чужие деньги» на ее экономическое ослабление.
- 3.2. Оцените рискованные требования к должностям председателя совета директоров и президента компании с личными рискованными характеристиками Йоргенсена и Коулса из кинофильма «Чужие деньги».
- 3.3. Оцените рискованные требования к должностям капитана атомной подводной лодки и его старпома с личными рискованными характеристиками каптеранга Фрэнка Рамсея и кавторанга Рона Хантера из кинофильма «Багровый прилив».
- 3.4. Составьте докладную записку командованию флота США о ваших предложениях о порядке подбора и тренировки взаимодействия капитанов и старпомов в ситуациях, выходящих за пределы инструкций.
- 3.5. Проанализируйте кинофильм «Чужие деньги» и составьте список всех финансовых документов, которые в нем упоминаются. Обсудите структуру и возможности этих инструментов в борьбе захватываемой фирмы и финансового рейдера.
- 3.6. Фирме «Проволока и кабель Новой Англии» из кинофильма «Чужие деньги» необходимо измениться. Какой она должна стать? Из каких источников фирма может профинансировать проект этой трансформации? Какая система риск-менеджмента требуется для защиты успеха проекта этой трансформации? Какой фонд финансирования системы риск-менеджмента потребуется фирме после внедрения проекта?
- 3.7. В фильме «Чужие деньги» есть два эпизода применения нетрадиционных финансовых инструментов.

*Эпизод 1.* Л. Гарфилд предлагает К. Салливан опцион (на лестнице после ужина у него дома). В чем дефект этого опциона?

*Эпизод 2.* Президент захватываемой компании Коул предлагает рейдеру приобрести у него права голосовать его простыми акциями (сцена в лимузине). В чем причина реализации риска инсайдерства? Как элиминировать этот риск?

3.8. По материалам ситуации «Чужие деньги» перечислите симптомы усиления рискованности рыночной позиции компании «Проволока и кабель» еще до появления финансового захватчика, которые не учли руководители компании Йоргенсен и Коулс. Что они должны были делать, но не делали?

#### Тема 4

4.1. Вместе с коллегами проведите анализ внутренней рискованности фирмы «Проволока и кабель Новой Англии» из фильма «Чужие деньги» по методике Симмонса. Сравните результаты разных людей. Проинтерпретируйте результаты и различия.

4.2. Проведите измерение рискованной температуры компании «Проволока и кабель». Прокомментируйте результаты по итогам просмотра фильма.

#### Тема 5

5.1. Какие стандарты по управлению организациями могут оказаться полезными при трансформации компании «Проволока и кабель Новой Англии» в глобальную, диверсифицированную и развивающуюся компанию с адекватной рискованной чувствительностью?

5.2. Какие стандарты по управлению рисками на атомных подводных лодках вы предложили бы по итогам анализа ситуации из кинофильма «Багровый прилив»?

5.3. Какие стандарты по управлению рисками на атомных подводных лодках вы предложили бы по итогам анализа ситуации из кинофильма «Неудержимый»?

5.4. Какие правила ведения бизнеса были нарушены в ситуации фирмы «Проволока и кабель Новой Англии» из кинофильма «Чужие деньги»? Составьте докладную записку на эту тему в адрес руководителя проекта трансформации этой фирмы в глобальную, мобильную и самообучающуюся организацию.

5.5. Какие правила поведения под риском были нарушены в ситуации подводной лодки «Алабама» из кинофильма «Багровый прилив»? Составьте докладную записку на эту тему в адрес командования ВМС США.

#### Темы рефератов и докладов

1. Проведите интернет-исследования по основным терминам, встречающимся в риск-менеджменте, и составьте краткий терминологический словарь по риск-менеджменту.
2. На основе интернет-исследования составьте реферат о персоналиях, внесших наиболее важные вклады в развитие теории и практики риск-менеджмента.
3. Составьте доклад об истории развития математических методов риск-менеджмента.
4. Сопоставление развития отрасли услуг по риск-менеджменту в России и в развитых странах Запада.
5. Концепция фрактальности в науке и бизнесе.
6. Основы целостного подхода к управлению организацией.
7. Анализ организационной структуры реальной организации и ее фрактальное представление.
8. Анализ жизненных циклов конкретной организации.
9. Состав и динамика влияния стейкхолдеров организации.
10. Подходы к разработке рискованного ландшафта конкретной организации.
11. Концепция рисков типа «черный лебедь».
12. Влияние хорошей системы управления рисками на инвестиционную, заемную, рыночную, технологическую мощь фирмы.
13. Пути сокращения резервов в пользу более продуктивных активов за счет раннего оповещения в системе управления рисками.

14. Снижение потерь за счет более профессиональных оценок рисков фирмы и усиления позиций в диалогах со страховщиками.
15. Влияние состояния риск-менеджмента в фирме на лояльность персонала.
16. Влияние состояния риск-менеджмента в фирме на закрепление клиентуры.
17. Влияние состояния риск-менеджмента в фирме на укрепление отношений с партнерами и поставщиками.
18. Целостный подход к оценке рисков организации.
19. Основы классификации (таксономии) рисков в бизнесе.
20. Источники рисков в бизнесе.
21. Управленческая диагностика рисков в бизнесе.
22. Пути создания системы управления рисками в коммерческой организации.
23. Ситуационное управление в системе риск-менеджмента коммерческой организации.
24. Разработка системы страхования рисков фирмы.
25. Распределение обязанностей по управлению рисками в коммерческой организации.
26. Методы выявления и измерения критических индикаторов риска в коммерческой организации.
27. Человеческая компонента в управлении рисками.
28. Поведение людей в рискованных ситуациях.
29. Человек как источник риска в бизнесе.
30. Типология типов личности по отношению к рискам.
31. Применение принципа «проверок и балансировки» (checks balances) к построению системы управления рисками организации.
32. Оценка рисков в методике оценки стоимости фирмы.
33. Финансовые риски коммерческой фирмы.
34. Финансовые риски на разных этапах жизненного цикла фирмы.
35. История и направленность базельского процесса в мировой экономике.
36. Участие России в базельском процессе.
37. Базельские соглашения как инструмент регулирования устойчивости экономики страны и мировой экономики.
38. Методы манипулирования операционными рисками фирмы.
39. Система стандартизации риск-менеджмента в США (Канаде, Великобритании, Австралии, Южно-Африканской республике).
40. Направления стандартизации риск-менеджмента в коммерческих организациях.
41. Разработка системы внутренних стандартов по управлению рисками в фирме.
42. Роль воспитания кадров в обеспечении адекватности рискованного поведения организации.
43. Проект создания целостной системы управления в конкретной организации.
44. Разработка личной системы адекватной защиты от рисков.
45. Способы накопления и обобщения опыта управления рисками в бизнесе.
46. Моя собственная программа самообразования в области управления рисками.

## **5. Оценочные материалы промежуточной аттестации по дисциплине**

### **5.1. Зачет проводится с применением следующих методов (средств)**

Промежуточная аттестация может быть реализована с элементами ЭО/ДОТ.

Устный ответ на вопросы билета. По результатам сдачи зачета с оценкой проставляются оценки «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно».

## 5.2. Оценочные материалы промежуточной аттестации

Таблица 6

Компонент компетенции	Промежуточный/ключевой индикатор оценивания	Критерий оценивания
ПКс-4.2Способен координировать деятельность исполнителей с помощью методического инструментария реализации управленческих решений	Студент координирует деятельность исполнителей с помощью методического инструментария реализации управленческих решений	Студент использует методы планирования проектов, выявлять рыночные возможности, методику составления бизнес-плана - цели, задачи, функции и основные этапы бизнес-планирования

### Типовые оценочные материалы промежуточной аттестации *Перечень вопросов для подготовки к зачету*

1. Понятие и сущность риска.
2. Виды рисков.
3. Сущность и содержание Риск-менеджмента.
4. Цель и задачи Риск-менеджмента
5. История возникновения Риск-менеджмента.
6. Основные аксиомы Риск-менеджмента.
7. Законы управления рисками.
8. Принципы Риск-менеджмента.
9. Понятие и сущность процессного подхода.
10. Внешний и внутренний мониторинг рисков.
11. Планирование в системе Риск-менеджмента
12. Организация как функция Риск-менеджмента
13. Мотивация как функция Риск-менеджмента
14. Регулирование в системе Риск-менеджмента
15. Учет и контроль в системе Риск-менеджмента
16. Оценка эффективности управления рисками.
17. Методы управления рисками.
18. Юридические методы управления рисками.
19. Административные методы управления рисками.
20. Экономические методы управления рисками.
21. Социально-психологические методы управления рисками.
22. Производственные методы управления рисками.
23. Научно-прикладные методы управления рисками.
24. Стратегия управления рисками.
25. Политика Риск-менеджмента
26. Тактическое управление рисками.
27. Принятие управленческих решений в условиях риска
28. Характеристика внешней среды организации.
29. Политические риски.
30. Экономические риски.
31. Природные риски.
32. Национальные риски.
33. Экологические риски.

34. Коммерческие риски.
35. Демографические риски.
36. Финансовые риски.
37. Криминогенные риски.
38. Инновационные риски.
39. Логистические риски.
40. Отраслевые и структурные риски.
41. Характеристика внутренней среды организации.
42. Организационные риски.
43. Технические и производственные риски.
44. Коммуникативные и информационные риски.
45. Социально-психологические риски.
46. Принятие управленческих решений в условиях неопределенности
47. Принятие управленческих решений в условиях определенности
48. Виды финансовых рисков в деятельности организации и их характеристика
49. Методы страхования рисков
50. Основные элементы системы Риск-менеджмента
51. Характеристика инструментов Риск-менеджмента
52. Мотивация и кадровое обеспечение Риск-менеджмента
53. Информационное обеспечение системы Риск-менеджмента
54. Моделирование в Риск-менеджменте
55. Количественные и качественные методы прогнозирования рисков.
56. Методы оценки внешней среды в системе Риск-менеджмента
57. Методы оценки внутренней среды в системе Риск-менеджмента
58. Методы прогнозирования в управлении рисками.
59. Неформальные методы прогнозирования.
60. Применение экспертных методов в Риск-менеджменте

### **Шкала оценивания.**

Оценка результатов производится на основе балльно-рейтинговой системы (БРС). Использование БРС осуществляется в соответствии с Приказом СЗИУ РАНХиГС от 06 сентября 2019 г. № 306 с изменениями от 22 января 2020 г. «О применении балльно-рейтинговой системы оценки знаний обучающихся».

При оценивании используется балльно-рейтинговая система, позволяющая осуществлять постоянный мониторинг усвоения студентами учебной программы курса во время аудиторных занятий, а также контролировать самостоятельную работу обучающихся. В течение семестра во время аудиторных и самостоятельных занятий по освоению дисциплины студент может набрать 60% от общего числа баллов, необходимых для получения соответствующей оценки. Баллы, полученные на зачете, прибавляются к уже заработанным в ходе семестра.

Критерии оценки знаний, навыков; описание параметров формирования баллов, присваиваемых во время освоения дисциплины:

1. Посещаемость лекционных занятий –20 баллов;
2. Текущий контроль предусматривает контрольные работы с подведением итогов в

баллах – 20 баллов;

3. Работа на практических занятиях (контрольные работы) – 20 баллов;

4. Ответ на зачете – до 40 баллов.

В институте принята следующая шкала перевода оценки из многобалльной в систему «зачтено»/ «не зачтено»:

Расчет итоговой рейтинговой оценки:

*Таблица 7*

от 0 до 50 баллов	«не зачтено»
от 51 до 100 баллов	«зачтено»

Описание системы оценивания

*Таблица 8*

<i>Оценочные средства (формы текущего контроля)</i>	<i>Показатели оценки</i>	<i>Критерии оценки</i>
Тестирование	Процент правильных ответов на вопросы теста	Тестирование по темам: Менее 60% – 0 баллов 61 – 75% – 1 балл 76 – 90% – 2 балла 91 – 100% – 3 балла Итоговое тестирование перед зачетом: Менее 60% – 0 баллов 61 – 75% – 6 баллов 76 – 90% – 8 баллов 91 – 100% – 10 баллов
Дискуссия	Задание демонстрирует навыки подготовки текста для публичного выступления, грамотное лингвистическое оформление текста, умение подобрать и донести до аудитории свои аргументы.	Задание выполнено без ошибок, все аргументы в публичной дискуссии защищены – 5 баллов Задание выполнено частично, отдельные тезисы не подкреплены аргументами – 3 балла Задание не выполнено – 0 баллов

Зачет проводится в форме контрольной работы (решения задач) по билетам. На зачет выносятся материал в объеме, предусмотренном рабочей программой учебной дисциплины.

Экзаменационный зачетный билет включает в себя две задачи. Содержание задач одного билета относится к различным разделам программы с тем, чтобы более полно охватить материал учебной дисциплины.

В процессе подготовки к зачету организуются предэкзаменационные консультации для всех учебных групп.

Как правило, зачет принимает преподаватель, читавший учебную дисциплину в данной учебной группе. В аудитории, где проводится зачет, одновременно находятся все студенты.

Для прохождения зачета студенту необходимо иметь при себе письменные принадлежности. На подготовку билета отводится 60 минут.

Не следует брать на зачет шпаргалки. А наличие посторонних материалов влечет за собой получение неудовлетворительной оценки.

При возникновении любых неясностей в процессе решения задачи следует обращаться с вопросами только к преподавателю. Разрешается пользоваться калькулятором.

## 6. Методические материалы по освоению дисциплины

### Методические рекомендации по подготовке к лекциям и семинарам

Таблица 9

Наименование темы или раздела дисциплины	Трудоемкость, час.	Список рекомендуемой литературы		Вопросы для самопроверки
		Основная (№ из перечня)	Дополнительная (№ из перечня)	
Основные этапы развития риск-менеджмента. Фрактальная модель организации.	10	1-5	1-6	Краткая история «борьбы с богами» и современный риск-менеджмент. О фрактальном подходе. Целостная модель организации. Ценности и экспозиции. Фрактальная модель организации и ее рискованного ландшафта. Чем и ради чего: смысл и ситуации рискования. Что может дать хороший целостный риск-менеджмент. Рисковый ландшафт и рискованные характеристики организации. Многоликий феномен риска. Аспекты риска, потерь и бенефитов. Целостное управление рисками —

Наименование темы или раздела дисциплины	Трудоемкость, час.	Список рекомендуемой литературы		Вопросы для самопроверки
		Основная (№ из перечня)	Дополнительная (№ из перечня)	
				парадигма упреждающего управления.
Риск как объект диагностики и оценки. Управленческий механизм риск-менеджмента.	10	1-5	1-6	Основы управленческой диагностики рисков. Формула риска. Преобразование базовой продвинутой формулы риска. Таксономия рисков. Пирамида риска: факторы, симптомы, бифуркации, контроль. Риск как объект диагностики и оценки. Модель функции риск-менеджмента в управлении фирмой. Распределение обязанностей по управлению рисками: Карты распределения ответственности. Защита от стратегических рисков. Подпрограмма защиты непрерывности бизнеса. Рутинный риск-менеджмент. Чрезвычайная ситуация. Управленческий механизм риск-менеджмента.
Человеческий и финансовый аспект управления рисками.	10	1-5	1-6	Индивидуальное и групповое поведение людей и управление рисками. Психологические особенности реакции на риск. Риски работы с кадрами. Оценка рисков аппетита сотрудников. Оценка потребного и фактического аппетита рисковей позиции. Зеленый офис экономит не только ресурсы и деньги, но и нервы. Человеческий аспект управления рисками. Риск, доходность и стоимость фирмы. Методы финансирования программы управления риском. Финансовые инструменты управления рисками. Финансовый аспект управления рисками.
Инструменты риск-менеджера.	10	1-5	1-6	Методический арсенал диагностики. Инструментарий управления рисками. Методики оценки политических рисков.

Наименование темы или раздела дисциплины	Трудоемкость, час.	Список рекомендуемой литературы		Вопросы для самопроверки
		Основная (№ из перечня)	Дополнительная (№ из перечня)	
				Когда требуется внешний консультант в сфере управления рисками. Инструментальный ящик риск-менеджера.
Стандартизация в риск-менеджменте.	10	1-5	1-6	Стандартизация в риск-менеджменте. Правила обращения с рисками.
Всего:	50			

## 7. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

### 7.1. Основная литература.

Все источники взаимозаменяемые

1. Вяткин, Валерий Нурович. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 365 с. — (Высшее образование). — Текст : электронный — URL: <https://www.ura.it.ru/viewer/risk-menedzhment-511018>. — Режим доступа: для авторизованных пользователей
2. Казакова, Н. А. Современный стратегический анализ : учебник и практикум для вузов / Н. А. Казакова. — 3-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 469 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-11138-5. — Текст : электронный — URL: <https://ura.it.ru/bcode/511185>. — Режим доступа: для авторизованных пользователей
3. Круи, Майкл. Основы риск-менеджмента / М. Круи, Д. Гэлаи, В. Б. Минасян, Р. Марк. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 390 с. — (Высшее образование). — Текст : электронный — URL: <https://ura.it.ru/viewer/osnovy-risk-menedzhmenta-510526>. — Режим доступа: для авторизованных пользователей
4. Пименов, Николай Анатольевич. Управление финансовыми рисками в системе экономической безопасности : учебник и практикум для вузов / Н.А. Пименов. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 326 с. — (Высшее образование). — Текст: электронный — URL: <https://ura.it.ru/viewer/upravlenie-finansovymi-riskami-v-sisteme-ekonomicheskoy-bezopasnosti-510935>. — Режим доступа: для авторизованных пользователей
5. Шкурко, Валентина Евгеньевна. Управление рисками проекта: учебное пособие для вузов / В.Е. Шкурко; под научной редакцией А.В. Гребенкина. — 2-е изд. — Москва: Издательство Юрайт, 2022. — 182 с. — (Высшее образование). — Текст: электронный — URL: <https://ura.it.ru/viewer/upravlenie-riskami-proekta-493673>. — Режим доступа: для авторизованных пользователей

### 7.2. Дополнительная литература.

1. Балдин, Константин Васильевич. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия [Электронный ресурс] : учеб. пособие /

- К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов. - 4-е изд. - Электрон. дан. - М. : Дашков и К, 2019. - 418 с. – URL: <https://www.iprbookshop.ru/epd-reader?publicationId=85180>. - Режим доступа: для авторизованных пользователей
2. Воронцовский, Алексей Владимирович. Управление рисками: учебник и практикум для вузов /А. В. Воронцовский. – 2-е изд. – Москва : Издательство Юрайт, 2023. – 485 с. (Высшее образование). – Текст: электронный - URL: <https://urait.ru/viewer/upravlenie-riskami-489580>. – Режим доступа: для авторизованных пользователей
  3. Кузнецов, Юрий Викторович. Теория организации : учебник и практикум для вузов / Ю.В. Кузнецов, Е.В. Мелякова. - 3-е изд., перераб. и доп. – Москва : Издательство Юрайт, 2023. – 351 с. – (Высшее образование). – Текст: электронный – URL: <https://urait.ru/viewer/teoriya-organizacii-510680>. - Режим доступа: для авторизованных пользователей
  4. Рягин, Юрий Игнатьевич. Рискология в 2 частях. Ч. 1 : учебник для вузов / Ю. И. Рягин. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 255 с. — (Высшее образование). — Текст : электронный — URL: <https://urait.ru/viewer/riskologiya-v-2-ch-chast-1-492118>. Режим доступа: для авторизованных пользователей
  5. Рягин, Юрий Игнатьевич. Рискология в 2 частях. Ч. 2 : учебник для вузов / Ю. И. Рягин. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 275 с. — (Высшее образование). — Текст : электронный — URL: <https://urait.ru/viewer/riskologiya-v-2-ch-chast-2-492120>. Режим доступа: для авторизованных пользователей
  6. Хоминич, Ирина Петровна. Управление финансовыми рисками : учебник и практикум для вузов / И.П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И.П. Хоминич - 2-е изд., испр. и доп. - Москва : Издательство Юрайт, 2023. - 569 с. - (Высшее образование). – Текст: электронный – URL: <https://urait.ru/viewer/upravlenie-finansovymi-riskami-511958>. - Режим доступа: для авторизованных пользователей

### **7.3. Нормативные правовые документы.**

1. Конституция Российской Федерации" (принята всенародным голосованием 12.12.1993) (с учетом поправок, внесенных Законами РФ о поправках к Конституции РФ от 30.12.2008 N 6-ФКЗ, от 30.12.2008 N 7-ФКЗ, от 05.02.2014 N 2-ФКЗ) // Собр. законодательства Рос. Федерации.- 2014.- № 9, ст. 851.

### **7.4. Интернет-ресурсы.**

1. e-Library.ru [Электронный ресурс]: Научная электронная библиотека. – URL: <http://elibrary.ru/> (дата обращения: 30.03.2023).
2. Научная электронная библиотека «КиберЛенинка» [Электронный ресурс]. – URL: <http://cyberleninka.ru/> (дата обращения: 30.03.2023).
3. Правовая система «Гарант-Интернет» [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.garweb.ru>.
4. Правовая система «КонсультантПлюс» [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.consultantru>.
5. Электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «Айбукс» <https://ibooks.ru/?ysclid=lg0jrply11272419827>
6. Статьи из журналов и статистических изданий EAST VIEW <https://www.eastview.com>

### **7.5. Иные источники**

Не используются

## 8. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы

### Характеристики аудиторий (помещений, мест) для проведения занятий

Для проведения занятий необходимы стандартно оборудованные учебные кабинеты и компьютерные классы, соответствующие санитарным и строительным нормам и правилам.

*Таблица 10*

№ п/п	Наименование
1.	Специализированные залы для проведения лекций:
2.	Специализированная мебель и оргсредства: аудитории
3.	Технические средства обучения: Персональные компьютеры; компьютерные проекторы; звуковые динамики; программные средства, обеспечивающие просмотр видеофайлов в форматах AVI, MPEG-4, DivX, RMVB, WMV.

На семинарских занятиях используется следующее программное обеспечение:

- программы, обеспечивающие доступ в сеть Интернет (например, «Google chrome»);
- программы, демонстрации видео материалов (например, проигрыватель «Windows Media Player»);
- программы для демонстрации и создания презентаций (например, «Microsoft Power Point»);
- пакеты прикладных программ SPSS/PC+, STATISTIKA,
- программные комплексы Word, ТЕСТУНИВЕРСАЛ,
- правовые базы данных «Консультант+», «Гарант», «Кодекс», «Эталон»