

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего
профессионального образования
Московский государственный университет имени М.В. Ломоносова
Филиал МГУ в г. Ереване

«УТВЕРЖДАЮ»
Директор Филиала МГУ
имени М.В.Ломоносова в г.Ереване
А.Н.Реймерс
" 5 " _____ 2022г.



РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Наименование дисциплины (модуля): **Управление рисками**

Направление подготовки: **38.03.04 «Государственное и муниципальное управление»**

Форма обучения: **очная**

Уровень квалификации выпускника: **бакалавр**

Курс 4
Семестр 7
Лекции 36
Лабораторные занятия _____
Практические занятия _____
Семинары 18
Форма контроля -зачет

Ереван – 2022

Автор программы: Н.В. Макогонова, к.э.н., доцент кафедры теории и методологии государственного и муниципального управления факультета государственного управления МГУ имени М.В.Ломоносова.

Программа дисциплины «Управление рисками» составлена в соответствии с требованиями к уровню подготовки бакалавра образовательного стандарта, самостоятельно устанавливаемого Московским государственным университетом имени М.В. Ломоносова по направлению подготовки «Государственное и муниципальное управление».

Программа утверждена на заседании Ученого Совета Филиала МГУ имени М.В. Ломоносова в г. Ереване 26 августа 2022 г, протокол № 2.

I. Название дисциплины: «Управление рисками»

Автор курса — Макогонова Надежда Владимировна, ученая степень: кандидат экономических наук, место работы: Московский государственный университет имени М.В. Ломоносова (кафедра теории и методологии государственного и муниципального управления факультета государственного управления), должность: доцент.

II. Шифр дисциплины _____ (присваивается Управлением академической политики и организации учебного процесса)

III. Цели и задачи освоения дисциплины «Управление рисками»

A. Цели дисциплины:

Основные цели дисциплины «Управление рисками» – сформировать у слушателей представление о риск-менеджменте как специальном виде управления и основной методологии менеджмента безопасности, сформировать у слушателей концептуальный подход к управлению рисками и навыки применения основных методов управления рисками (исключение, снижение, компенсация, поглощение) *в организации или группе хозяйствующих субъектов* (риск-менеджмент организации), *в сложных динамических системах* (отраслевой риск-менеджмент, региональный риск-менеджмент, сити риск-менеджмент и др.), а также *в исключительных хозяйствующих субъектах* - общественно-значимых и (или) системообразующих организациях, монопрофильных городах, столицах государств и др. (далее - структуры), в свою очередь, в целях постановки/восстановления, внедрения и осуществления надлежащей организации и эффективного функционирования в структурах систем управления рисками и контроля.

Б. Задачи дисциплины:

Основными задачами дисциплины «Управление рисками» являются достижение следующих образовательных результатов, а именно:

(1) сформировать представление об области применения риск-ориентированного подхода в современной теории и практике управления;

(2) заложить концептуальные, институциональные и процедурные основы риск-менеджмента, в том числе, сформировать понимание архитектуры риск-менеджмента (принципы риск-менеджмента, инфраструктура риск-менеджмента, процесс риск-менеджмента) и общий подход для поддержки стандартов риск-менеджмента, распространяющихся на конкретные риски и (или) отрасли (в целях гармонизации процессов управления рисками, описанных в семействе стандартов управления рисками);

(3) овладеть методами оценки риска и управления рисками (угрозами) хозяйственной деятельности экономического субъекта в целях их снижения до приемлемого (допустимого) уровня;

(4) применить инструментарий (процедуры) риск-менеджмента на примере отдельно взятого экономического (хозяйствующего) субъекта в ходе выполнения коллективного/индивидуального проекта;

(5) усвоить требования и процедуры передовых стандартов и практик по управлению рисками, в том числе: (а) стандартов серии ISO 31000, (б) UNECE. Risk Management in Regulatory Frameworks: Towards a Better Management of Risks, UNECE. Recommendation on Risk Management in Regulatory Systems, UNECE. Recommendation on Crisis Management in Regulatory Systems, (в) COSO's Internal Control – Integrated framework, др.

IV. Место дисциплины в структуре ООП

А. Информация о месте дисциплины в образовательном стандарте и учебном плане

Дисциплина входит в вариативную часть дисциплин по выбору. Обучение дисциплине «Управление рисками» осуществляется на 4 курсе бакалавриата в первом семестре.

Б. Перечень дисциплин, которые должны быть освоены до начала освоения данной дисциплины: Теория управления; Основы государственного и муниципального управления; Принятие и исполнение государственных решений; Стратегический менеджмент; Финансовый менеджмент; Методы принятия управленческих решений; Государственное регулирование экономики.

В. Общая трудоёмкость дисциплины составляет 108 ч./ 3 зачетные единицы

Г. Форма промежуточной аттестации — зачет.

V. Формы проведения:

аудиторная нагрузка 54 ак. ч:

- лекции 36 ак. часов;
- семинары 18 ак. часов;
- самостоятельная работа 54 ак. часов.
- формы текущего контроля (контрольные, письменные работы, опросы)

VI. Распределение трудоемкости по разделам и темам, а также формам проведения занятий с указанием форм текущего контроля и промежуточной аттестации

№ п/п	Наименование разделов и тем дисциплины	Трудоемкость (в ак. часах) по формам занятий			Формы текущего контроля успеваемости (<i>по неделям семестра</i>) Форма промежуточной аттестации (<i>по семестрам</i>)
		Лекции	Семинары	Самостоятельная работа	
1	Лекция 1. Вводная лекция по курсу «Управление рисками», или Приглашение к размышлению о месте и роли риск-ориентированного подхода в управлении	2	2	4	Опрос Дискуссия

2	Тема семинара № 1. Формы контроля и организация работы со слушателями. Инициативный опрос	2	-	2	Опрос Дискуссия
3	Лекция 2. Общий подход для поддержки стандартов риск-менеджмента, распространяющихся на конкретные риски и (или) отрасли (в целях гармонизации процессов управления рисками, описанных в действующих и будущих стандартах)	2	2	4	Опрос Дискуссия
4	Тема семинара № 2. Обоснование выбора хозяйствующего субъекта. Формирование общего представления о деятельности хозяйствующего субъекта в целях выполнения коллективного/индивидуального проекта	2	-	2	Опрос Дискуссия
5	Лекция 3. Архитектура риск-менеджмента, или Существенные взаимосвязи риск-менеджмента (принципы-инфраструктура-процесс)	2	2	4	Опрос Дискуссия
6	Тема семинара № 3. Защита понимания деятельности экономического субъекта, среды его функционирования и оценки хозяйственных рисков	2	-	2	Опрос Дискуссия
7	Лекция 4. Этапы процесса оценки риска и обзор стандартных методов оценки риска (31), или К вопросу о выборе метода оценки риска	2	2	4	Опрос Дискуссия
8	Тема семинара № 4. Защита Плана и Программы коллективного/индивидуального проекта по	2	-	2	Опрос Дискуссия

	установленной форме				
9	Лекция 5. Более детальный обзор некоторых стандартных методов оценки риска (13) и наиболее известных методов оценки риска (VAR, stress-testing, EAR)	2	2	4	Опрос Дискуссия
10	Тема семинара № 5. Защита достигнутых результатов осуществленных процедур в рамках коллективного/индивидуального проекта, обоснование выбора итогового документа	2	-	2	Опрос Дискуссия
11	Лекции 6-7. Воздействие на риск, или Базовые (основные) риск-стратегии: исключение, снижение, компенсация и поглощение	4	4	8	Опрос Дискуссия
12	Тема семинаров № 6-7. Защита итогового документа в рамках коллективного/индивидуального проекта в подгруппах первой очереди	4	-	4	Опрос Дискуссия
13	Лекция 8. Обзор лекционного курса	2	2	4	Опрос Дискуссия
14	Тема семинара № 8. Защита итогового документа в рамках коллективного/индивидуального проекта в подгруппах второй очереди	2	-	2	Опрос Дискуссия
15	Лекция 9. Конференция	2	2	4	Дискуссия
16	Итоговая контрольная работа	2	-	2	Опрос
17	ИТОГО	36	18	54	Зачет

VII. Содержание дисциплины по разделам и темам — аудиторная и самостоятельная работа

Тема ЛЕКЦИИ № 1. Вводная лекция по курсу «Управление рисками», или Приглашение к размышлению о месте и роли риск-ориентированного подхода в управлении. (1) Управление рисками, или Риск-менеджмент как специальный вид управления. (2) Некоторые базовые категории, понятия и концепции риск-менеджмента в

ретроспективе. (3) Концептуальный подход и методы управления рисками. (4) Санкт-Петербургский парадокс, или Как все начиналось?! (5) Практическое задание по курсу «Управление рисками».

Тема ЛЕКЦИИ № 2. Общий подход для поддержки стандартов риск-менеджмента, распространяющихся на конкретные риски и (или) отрасли (в целях гармонизации процессов управления рисками, описанных в действующих и будущих стандартах). (1) Современные феномены. (2) Атомарная модель риск-менеджмента (субъект и объекты управления рисками). (3) Мегафакторы хозяйственных рисков. (4) Парадигмы риск-менеджмента (фрагментированный и интегрированный (комплексный) риск-менеджмент). (5) Идентификация уровня сложности риск-менеджмента. (6) Существенные взаимосвязи риск-менеджмента (*принципы-инфраструктура-процесс*), или Архитектура риск-менеджмента: принципы риск-менеджмента.

ТЕМА ЛЕКЦИИ № 3. Архитектура риск-менеджмента, или Существенные взаимосвязи риск-менеджмента (принципы-инфраструктура-процесс). (1) «Модульный подход» к пониманию деятельности экономического субъекта, среды его функционирования и оценке риска, или модель «5-ти проблем». (2) Структура политики риск-менеджмента. (3) Место и роль управленческого учета и нефинансовой отчетности в системе внутреннего контроля.

ТЕМА ЛЕКЦИИ № 4. Этапы процесса оценки риска и обзор стандартных методов оценки риска (31), или К вопросу о выборе метода оценки риска. 1. Мозговой штурм. 2. Структурированные или частично структурированные интервью. 3. Метод Дельфи. 4. Контрольные листы. 5. Предварительный анализ опасностей (PHA). 6. Исследование опасности и работоспособности (HAZOP). 7. Анализ опасности и критических контрольных точек (НАССР). 8. Оценка токсикологического риска. 9. Структурированный анализ сценариев методом «что, если?» (SWIFT). 10. Анализ сценариев. 11. Анализ воздействия на бизнес (BIA). 12. Анализ первопричины (RCA). 13. Анализ видов и последствий отказов (FMEA). 14. Анализ дерева неисправностей (FTA). 15. Анализ дерева событий (ETA). 16. Анализ причин и последствий. 17. Причинно-следственный анализ. 18. Анализ уровней защиты (LOPA). 19. Анализ дерева решений. 20. Анализ влияния человеческого фактора (HRA). 21. Анализ «галстук-бабочка». 22. Техническое обслуживание, направленное на обеспечения надежности. 23. Анализ скрытых дефектов (SA). 24. Марковский анализ. 25. Моделирование методом Монте-Карло. 26. Байесовский анализ и сети Байеса. 27. Кривые FN. 28. Индексы риска. 29. Матрица последствий и вероятностей. 30. Анализ эффективности затрат. 31. Мультикритериальный анализ решений (MCDA).

ТЕМА ЛЕКЦИИ № 5. Более детальный обзор некоторых стандартных методов оценки риска (13) и наиболее известных методов оценки риска (VAR, stress-testing, EAR). 1. Структурированные или частично структурированные интервью. 2. Контрольные листы. 3. Структурированный анализ сценариев методом «что, если?» (SWIFT). 4. Анализ сценариев. 5. Анализ воздействия на бизнес (BIA). 6. Анализ первопричины (RCA). 7. Анализ дерева событий (ETA). 8. Анализ причин и последствий. 9. Причинно-следственный анализ. 10. Анализ влияния человеческого фактора (HRA). 11. Матрица последствий и вероятностей. 12. Анализ эффективности затрат. 13. Мультикритериальный анализ решений (MCDA). 14. VAR. 15. Stress-testing. 16. EAR.

ТЕМА ЛЕКЦИЙ № 6-7. Воздействие на риск, или Базовые (основные) риск-стратегии: исключение, снижение, компенсация и поглощение. Часть I. Основные формы реализации стратегии исключения рисков: (1) предупреждение,

(2) приостановление и (или) прекращение осуществляемой деятельности, (3) отказ от планируемой деятельности. Контроль как главная форма реализации стратегии снижения рисков. **Часть II.** Стратегия компенсации рисков: область применения и риски стратегии компенсации. Стратегия поглощения рисков: сфера применения и риски стратегии поглощения. Оценка инфраструктуры отчетности по рискам в Российской Федерации, в том числе, в государственном секторе.

ТЕМА ЛЕКЦИИ № 8. Обзор лекционного курса

ТЕМА ЛЕКЦИИ № 9. Конференция.

Самостоятельная работа к семинарам № 1-2: Формы контроля и организация работы со слушателями. Инициативный опрос. Самоорганизация в целях выполнения коллективного или индивидуального проекта. Организация отбора экономического субъекта и *его утверждение* в целях выполнения коллективного/индивидуального проекта.

Самостоятельная работа к семинару № 3: Определение задач ответственного исполнителя и других исполнителей в рамках подгрупп, проведение первичного совещания по планированию в рамках подгрупп, формализация условий в целях выполнения коллективного/индивидуального проекта.

Самостоятельная работа к семинару № 4: Закрепление проблем/сегментов/элементов и т. д. за определенными членами подгруппы. Проработка закрепленных участков в целях выступления на семинаре по согласованной модели понимания деятельности хозяйствующего субъекта. Закрытие этапа предварительного планирования.

Самостоятельная работа к семинару № 5: Разработка общей стратегии и детального подхода к ожидаемому характеру, срокам проведения и объему процедур для достижения установленной цели. Данные по планированию. Закрытие этапа планирования.

Самостоятельная работа к семинару № 6-7: Осуществление запланированных процедур в целях сбора доказательств. Организация выбора итогового отчетного документа. Формализация осуществленных процедур и формирование *сводного* отчетного документа. Закрытие этапа осуществления.

Самостоятельная работа к семинару № 8: Формирование итоговой презентации и *первичного итогового* отчетного документа **в целях устного этапа защиты курсового проекта на семинаре.** Закрытие заключительного этапа. Формирование *скорректированного итогового* отчетного документа и его отправление в день устной защиты по эл. почте Лектору **в целях письменного этапа защиты курсового проекта** с последующим получением рецензии Лектора.

VIII Перечень компетенций, формируемых в результате освоения дисциплины «Управление рисками»

Изучение дисциплины «Управление рисками» направлено на формирование у обучающегося следующих компетенций:

Профессиональные компетенции:

- способность принимать решения в условиях неопределенности и рисков (ПК-4);
- знать и уметь адаптировать лучшие практики зарубежного государственного и муниципального управления к своей профессиональной деятельности (ПК-28);

- способность использовать современные методы управления проектом, направленные на своевременное получение качественных результатов, определение рисков и управление бюджетом (ПК-55).

IX. Используемые образовательные, научно-исследовательские, научно-производственные технологии

А. Образовательные технологии

- лекции и семинары;
- обучение действием на основе выполнения практических заданий;
- интерактивная часть занятий проходит в форме обсуждения индивидуальных практических заданий, дискуссий по темам.

Б. Научно-исследовательские технологии

В ходе учебного процесса при выполнении самостоятельной работы, а также при обсуждении её результатов в рамках интерактивных форм взаимодействия:

- метод «мозгового штурма» (брейнсторминга);
- технологии проектной командной работы.

В. Научно-производственные технологии

Ознакомление с направленными материалами и подготовка к ответам на вопросы для повторения и к дискуссии.

X. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов, оценочные средства контроля успеваемости и промежуточной аттестации

Учебно-методические рекомендации для обеспечения самостоятельной работы студентов:

Основные формы самостоятельной работы:

- подготовка к опросу по темам лекций и семинаров;
- подготовка к дискуссиям, ознакомление с текстом заданных источников;
- выполнение индивидуальных и групповых проектов;
- подготовка докладов.

Степень освоения курса определяется различными формами контроля:

- текущий контроль (систематическое посещение занятий и степень готовности и активности в ответах на вопросы, вынесенных для повторения, участие в дискуссиях);
- промежуточный контроль – проверка усвоения теоретических знаний из лекций и литературы, рекомендованной для самостоятельного чтения посредством опроса и практических заданий.

Форма заключительного контроля – зачет.

Примерные темы семестровых групповых проектов по курсу

1. Вызовы и риски современного управления организациями
2. Теория риска и моделирование рисков ситуаций
3. Когнитивные и психофизические факторы оценки ценности в условиях риска
4. Парадигмы риск-менеджмента
5. Виды рисков и их классификация

6. Архитектура эффективного управления рисками
7. Оценка проектных рисков
8. Риск-менеджмент в общественно значимых хозяйствующих субъектах
9. Оценка рисков реализации государственных программ
10. Государственный контроль и управление специфическим риском
11. Государственный риск-менеджмент и корпоративный риск-менеджмент: сходства и различия
12. Риск-ориентированный подход в сфере государственного управления: оценка перспектив
13. Риски властной, партнерской и принципал-агентской модели отношений
14. Угрозы нарушения принципов профессиональной (административной) этики
15. Управление рисками процесса осуществления государственных преобразований
16. Управление рисками реализации государственных программ
17. Оценка трансформационных рисков
18. Оценка рисков функционирования государственных систем
19. Оценка рисков государственных процессов
20. Оценка регуляторных рисков
21. Оценка рисков мегапроектов.

Примерный список вопросов для проведения итоговой аттестации

1. Перечислите, пожалуйста, процедуры и объясните, почему именно указанные Вами процедуры требуется провести на ЭТАПЕ ПРЕДВАРИТЕЛЬНОГО ПЛАНИРОВАНИЯ риск-менеджмента?
2. Каким образом и в какой мере можно снизить РИСКИ ПРОФЕССИОНАЛЬНОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ РИСК-МЕНЕДЖЕРА?
3. Какие ПРИНЦИПИАЛЬНЫЕ РАЗНОГЛАСИЯ и в чем между консультантом по риск-менеджменту и руководством собственника или представителями собственника организации-КЛИЕНТА могут привести к отказу от выполнения задания со стороны консультанта по риск-менеджменту?
4. «5 почему» операции в регионах, которые являются экономически нестабильными (например, в странах со значительной девальвацией валюты или экономикой с высоким уровнем инфляции), могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
5. «5 почему» ограничения возможностей организации по привлечению средств могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
6. «5 почему» несоответствие стратегии организации в области информационных систем и стратегии в области хозяйственной деятельности могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
7. «5 почему» запросы, направленные контролирующими органами организации, могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
8. «5 почему» операции, которые проведены в соответствии со специальными указаниями руководства организации (например, реструктуризация долга, активы, подлежащие продаже, и классификация ликвидных ценных бумаг), могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
9. «5 почему» операции, требующие многокритериальных оценок, многоступенчатых расчетов, могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
10. «5 почему» незавершенные судебные дела и обремененные условиями обязательства (например, гарантии по продажам, финансовые гарантии или обязательства в

- отношении восстановления окружающей среды), могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
11. Перечислите, пожалуйста, процедуры и объясните, почему именно указанные Вами процедуры требуется провести на ЭТАПЕ ПЛАНИРОВАНИЯ риск-менеджмента?
 12. Каким образом и в какой мере можно снизить РИСКИ СУБЪЕКТА ХОЗЯЙСТВЕННОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ?
 13. Каким образом и в какой мере можно повысить НАДЕЖНОСТЬ ПРОЦЕДУРЫ ПРИНЯТИЯ СТРАТЕГИЧЕСКИХ РЕШЕНИЙ на примере отдельно взятой организации малого и среднего бизнеса, предварительно описанной Вами?
 14. «5 почему» операции, зависящие от неустойчивых рынков (например, фьючерсная торговля), могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
 15. «5 почему» изменения в отрасли, в которой осуществляет свою деятельность организация, могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
 16. «5 почему» предполагаемые продажи хозяйственных или географических сегментов деятельности могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
 17. «5 почему» значительный объем операций со связанными сторонами может указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
 18. «5 почему» недостатки в системе внутреннего контроля (в особенности те, на которые руководство не обращает внимания) могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
 19. «5 почему» установка принципиально новых информационных систем может указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
 20. «5 почему» события или хозяйственные операции, которые сопряжены с существенной неопределенностью стоимостных параметров (например, оценочные показатели) могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
 21. Перечислите, пожалуйста, процедуры и объясните, почему именно указанные Вами процедуры требуется провести на этапе ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ риск-менеджмента?
 22. Каким образом и в какой мере можно повысить ЭФФЕКТИВНОСТЬ ФУНКЦИОНИРОВАНИЯ на примере отдельно взятой организации малого и среднего бизнеса, предварительно описанной Вами?
 23. Какие РЕШЕНИЯ Вы как риск-менеджер предложили бы принять представителям собственника организации, если бы Вы как риск-менеджер выявили ошибки/недобросовестные действия в деятельности руководства? Обоснуйте, почему именно эти решения считаете наиболее приемлемыми?
 24. «5 почему» высокий уровень сложности нормативного регулирования может указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
 25. «5 почему» изменения в сети поставщиков могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
 26. «5 почему» такие изменения в деятельности организации, как крупные приобретения или реорганизация, могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
 27. «5 почему» сложные финансовые расчеты, предполагающие обязательства организации, которые не отражаются в его бухгалтерской (финансовой) отчетности, могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?

28. «5 почему» нехватка персонала с надлежащими навыками может указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
29. «5 почему» искажения, ошибки, допущенные в предыдущие периоды, значительный объем корректирующих действий могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
30. «5 почему» введение в корпоративную стратегию, бизнес-стратегию, функциональную стратегию новых принципов, стандартов, положений, инструкций может указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
31. Перечислите, пожалуйста, процедуры и объясните, почему именно указанные Вами процедуры требуется провести на **ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНОМ ЭТАПЕ** риск-менеджмента?
32. Каким образом и в какой мере можно повысить **ЭФФЕКТИВНОСТЬ ФУНКЦИОНИРОВАНИЯ** на примере отдельно взятой организации крупного бизнеса, предварительно описанной Вами?
33. Какие **ПРАВИЛА** риск-менеджмента Вы действительно считаете допустимыми и приемлемыми, а какие нет на примере отдельно взятой организации предварительно описанной Вами? Объясните, почему?
34. «5 почему» вопросы, связанные с непрерывностью деятельности и ликвидностью (например, в случае потери организацией важных клиентов), могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
35. «5 почему» разработка или предложение новых видов товаров, работ или услуг либо освоение новых видов деятельности может указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
36. «5 почему» перемещение хозяйственной деятельности в новые регионы может указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
37. «5 почему» сложные схемы объединения или совместной деятельности могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
38. «5 почему» изменения, связанные с основным управленческим персоналом, включая увольнение руководителей, могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
39. «5 почему» изменения в информационных системах могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?
40. «5 почему» существенный объем нетиповых операций или неповторяющихся операций, включая операции внутри группы компаний и операции, связанные с возникновением значительного дохода в конце отчетного периода, могут указывать на существенные риски в деятельности организации и (или) среде ее функционирования?

Х. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов, оценочные средства контроля успеваемости и промежуточной аттестации

а) основная литература:

1. [ГОСТ Р ИСО 31000-2018. Менеджмент риска. Принципы и руководство.](#)
2. [ГОСТ Р ИСО/МЭК 31010-2011. Менеджмент риска. Методы оценки риска.](#)
3. UNECE (2012). Risk Management in Regulatory Frameworks: Towards a Better Management of Risks. United Nations. New York and Geneva, 2012. Available from: http://www.unece.org/fileadmin/DAM/trade/Publications/WP6_ECE_TRADE_390.pdf
4. UNECE (2011b). “Recommendation on Risk Management in Regulatory Systems”. Available from <http://www.unece.org/trade/wp6/recommendations/recommendations.html>.
5. UNECE (2011c). “Recommendation on Crisis Management in Regulatory Systems”. Available from: <http://www.unece.org/trade/wp6/recommendations/recommendations.html>.
6. COSO's Internal Control – Integrated framework. 2017.

7. Глазьев С.Ю. Актуальные проблемы развития российской экономики – С-Пб.: Санкт-Петербургский гуманитарный университет профсоюзов Санкт-Петербург, 2017 – 48 с. – ISBN 978-5-7621-0924-6
8. Городнова Н.В. Государственный риск-менеджмент: учебное пособие. — Екатеринбург: УрФУ. 2016.
9. Вяткин В. Н. Риск-менеджмент: учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — М. : Издательство Юрайт, 2016. — 353 с. — (Серия: Авторский учебник). — ISBN 978-5-9916-8357-9.
10. Дамодаран А. Стратегический риск-менеджмент: принципы и методики: Пер. с англ. – М.: ООО «И. Д. Вильямс», 2010. Pearson Education, Inc., 2008.
11. Проактивный кризис-менеджмент (диагностика и реструктуризация): учеб. пособие/Под ред. Н. А. Львовой, Н. В. Покровской. М.: Проспект, 2017. 240 с.
12. Круи М. Основы риск-менеджмента: пер. с англ. / М. Круи, Д. Галай, Р. Марк. М.: Юрайт, 2015.
13. Кузнецова В.В. Управление суверенной задолженностью: учебное пособие // В.В. Кузнецова. – М.: ИНФРА-М, 2017. – 255 с.
14. Норман П. Управляя рисками. Клиринг с участием центральных контрагентов на глобальных финансовых рынках / Питер Норман; Пер. с англ. – М.: Манн, Иванов и Фарбер, 2013.
15. Линдгрэн М., Бандхольд Х. Сценарное планирование. Связь между будущим и стратегией. 2009.
16. Государственный аудит. – УП Принт, М.: 2010. – 623 с.
17. Стиглиц Дж. Доклад Стиглица. О реформе международной валютно-финансовой системе: уроки глобального кризиса. Доклад Комиссии финансовых экспертов ООН. – М.: Междунар. отношения. 2010. – 328 с.
18. Кудрявцев А.А. Интегрированный риск-менеджмент. Серия: Учебники экономического факультета СПбГУ. 2010.
19. Тепман Л. Н. Управление рисками. – М., 2009.
20. Рекомендации ФАТФ. Международные стандарты по противодействию отмыванию денег, финансированию терроризма и финансированию распространения оружия массового уничтожения / Пер. с англ. – М.: Вече, 2010.

б) дополнительная литература:

1. Акимов В.А., Порфирьев Б.Н. Кризисы и риск: к вопросу взаимосвязи категорий // Проблемы анализа риска. 2004, Том 1. № 1, стр. 38 – 49.
2. Бартон Томас Л., Шенкир Уильям Г., Волкер Пол Л. Риск-менеджмент. Практика ведущих компаний: Пер. с англ. – М.: Издательский дом «Вильямс», 2008. © Financial Executives Research Foundations, Inc., 2002.
3. Бобылева А. З. Финансовый менеджмент. Проблемы и решения. – М., 2007.
4. Гаврилова Е. В. Страхование. – М., 2012.
5. Гринин Л. Е., Малков С. Ю., Пантин В. И., Чернавский Д. С. Угрозы развитию России и задачи стратегического планирования // Экономические стратегии. № 7 (132) 2015. сс. 46 – 59.
6. Кудина М. В. Управление компанией. – М., 2012.
7. Купряшин Г.Л. Кризисы государственного управления: неинституциональный подход // Государственное управление. Электронный Вестник. (Электронный журнал). 2015, № 51.
8. Купряшин Г.Л. Кризисы трансформации государственного управления Российской Федерации (1990-2000) // Вестник Московского университета. Сер. 21. Управление (государство и общество). 2016, №1.
9. Лукасевич И. Я. Инвестиции: Учебник. – М.: Вузовский учебник: ИНФРА-М, 2011.
10. Макогонова Н. В. Информационное обеспечение управленческих решений в

- коммерческих организациях: Монография. – М.: МАКС Пресс, 2012. Электронная копия доступна по адресу: <https://moscowstate.academia.edu/NadyezhdaVMakogonova>
11. *Макогонова Н. В.* Актуальные проблемы государственного контроля в Российской Федерации в период формирования национальной системы стратегического планирования // Государственное управление Российской Федерации: вызовы и перспективы // Материалы 14-й Международной конференции Государственное управление в XXI веке. — КДУ, Университетская книга Москва, 2017. — С. 457–466.
 12. *Макогонова Н. В.* Государственный контроль и управление риском // Стратегическое антикризисное управление: глобальные вызовы и роль государства. — Сборник VI Международной научно-практической конференции. — Издательство Перо Москва, 2016. — С. 82–89.
 13. *Макогонова Н. В.* Контроль рисков стратегических разрывов и расфокусировки в период формирования национальной системы стратегического управления в Российской Федерации // *Экономика и предпринимательство*. — 2017. — № 7. — С. 599–605.
 14. *Макогонова Н. В.* Обновляем систему внутреннего контроля на функционирующем государственном (муниципальном) унитарном предприятии и (или) в коммерческой организации с государственным участием (негосударственный сектор) // Государственное управление в XXI веке: повестка дня российской власти: 10-я Международная научная конференция факультета государственного управления МГУ имени М. В. Ломоносова, 29 - 31 мая 2012 г.: Материалы: В 3 ч.: Часть 1. — Т. 1. *Материалы конференций*. — Издательство Московского университета Москва, 2013. — С. 478–488. Электронная копия доступна по адресу: <http://istina.msu.ru/publications/article/2167635/>
 15. *Макогонова Н. В.* Существенные взаимосвязи между принципами, инфраструктурой и процессом менеджмента риска в публичном кризисном управлении // Государственное управление: Российская Федерация в современном мире. XII Международная конференция факультета государственного управления МГУ имени М. В. Ломоносова, 29–31 мая 2014 г. — Материалы международной конференции. — М.: Инфра-М, 2015. — С. 276–280. Электронная копия доступна по адресу: <http://istina.msu.ru/publications/article/7139583/>
 16. *Малган Дж.* Искусство государственной стратегии: Мобилизация власти и знания во имя всеобщего блага [Текст] / пер. с англ. Ю. Каптуревского под научн. ред. Я. Охонько. М.: Изд. Института Гайдара, 2011.
 17. *Минцберг Г.* Требуется управленцы, а не выпускники МВА. Жесткий взгляд на мягкую практику управления и систему подготовки менеджеров. – М.: Олимп-Бизнес, 2010.
 18. Отчет о результатах экспертно-аналитического мероприятия «Мониторинг развития системы государственных и корпоративных закупок в Российской Федерации», или К вопросу о коррупционных рисках // Бюллетень Счетной Палаты №. 7 (июль) 2017 г.
 19. *Рудык Н. Б.* Поведенческие финансы или между страхом и алчностью. – М.: Дело, 2004.
 20. *Сажина М. А.* Научные аспекты экономической политики государства. – М., 2011.
 21. *Сажина М. А.* Управление кризисом. – М., 2012.
 22. *Талев Н.* Черный лебедь: под знаком непредсказуемости. – М.: Колибри, 2009.
 23. *Токун Л.В., Шаманина Е.И.* Риск-ориентированный подход в управлении общественными финансами // Вестник ГУУ. 2014. № 12. С.168-174.
 24. Управление развитием национальной экономики на федеральном уровне (Материалы круглого стола 26.10.2016) / С.Ю. Глазьев, Р. М. Нижегородцев, Г.Л. Купряшин, Н.В. Макогонова, О.С. Сухарев // *Государственное управление. Электронный вестник (Электронный журнал)*. — 2017. — № 60. — С. 6–33.
 25. Analytical models and tools for identification and systemic risks // ECB Financial Stability Review, June 2017.
 26. *Makogonova N. V.* Improvement of the internal control system in an operating state (municipal) unitary enterprise and (or) commercial organization with government participation

- (commercial sector) // Вестник Таджикского национального университета, научный журнал, серия экономических наук, 2/5(172), ISSN 2074-1847, Душанбе, 2015. pp. 77-82. Электронная копия доступна по адресу: http://www.tnu.tj/vestnik/vestnik2015_2_5.pdf
27. Sharpe William F. Capital Asset Prices: A Theory of Market Equilibrium under Conditions of Risk // *The Journal of Finance*. Vol. 19, No. 3 (Sep., 1964), pp. 425-442.
28. The Global Risks Report 2017.

в) программное обеспечение и Интернет-ресурсы

29. <https://www.theirm.org/>
30. <http://rrms.ru>;
31. <http://www.behaviouralfinance.net>;
32. <http://www.cfainstitute.org>;
33. <http://www.conference-board.org/>
34. <http://www.ferma.eu>;
35. <http://www.irmsa.org.za>;
36. <http://www.iso.org/iso/home.htm>;
37. <http://www.palisade.com>;
38. http://www.reglament.net/bank_offer_risk_manager.htm
39. <http://www.sba.gov>
40. <http://www.ssrn.com/>
41. <https://www.minfin.ru/ru/>
42. www.mhhe.com/thompson

XII. Материально-техническое обеспечение дисциплины «Управление рисками»

Учебный процесс предполагает использование мультимедийного оборудования для проведения презентаций лекций, групповых практических заданий студентов (ТСО: компьютер, проектор и экран либо компьютер и плазменная панель):

- Оборудование для компьютерной презентации
- Компьютер с подключением к сети Интернет
- Программное обеспечение, MS Word, PowerPoint, Prezi
- Множительная техника (ксерокс) для подготовки раздаточных материалов

Аннотация рабочей программы дисциплины Управление рисками

Дисциплина «Управление рисками» относится к дисциплинам по выбору подготовки студентов по направлению 38.03.04 «Государственное и муниципальное управление». Дисциплина реализуется на факультете государственного управления МГУ имени М.В.Ломоносова кафедрой теории и методологии государственного и муниципального управления.

Дисциплина нацелена на формирование следующих компетенций выпускника, а именно:

Профессиональные компетенции:

- умение определять приоритеты профессиональной деятельности, разрабатывать и эффективно исполнять управленческие решения, в том числе в условиях неопределенности и рисков, применять адекватные инструменты и технологии регулирующего воздействия при реализации управленческого решения.

Содержание дисциплины охватывает круг вопросов, связанных с формированием у бакалавров понимания риск-менеджмента как специального вида управления и основной методологии менеджмента безопасности, курс нацелен на формирование у слушателей концептуального подхода к управлению рисками и практических навыков применения основных методов оценки риска в ходе процесса оценки, и, в свою очередь, генерирования стратегий управления рисками (исключение, снижение, компенсация, поглощение) *в организации или группе хозяйствующих субъектов (риск-менеджмент организации), в сложных динамических системах (отраслевой риск-менеджмент, региональный риск-менеджмент, сити риск-менеджмент и др.), а также в исключительных хозяйствующих субъектах* - общественно-значимых и (или) системообразующих организациях, монопрофильных городах, столицах государств и др. (далее - структуры). Кроме того, курс направлен на постановку/восстановление, внедрение и осуществление надлежащей организации и эффективного функционирования в структурах систем управления рисками и контроля, в том числе, на базе применения требований (а) стандартов серии ISO 31000; (б) UNECE. Risk Management in Regulatory Frameworks: Towards a Better Management of Risks, UNECE. Recommendation on Risk Management in Regulatory Systems, UNECE. Recommendation on Crisis Management in Regulatory Systems; (в) COSO's Internal Control – Integrated framework, др.

Преподавание дисциплины предусматривает следующие формы организации учебного процесса: лекции, семинары, самостоятельная работа с направленными источниками и материалами, выступления с сообщениями и докладами по вынесенным на проработку и обсуждение вопросам в рамках темы проблемно-ориентированного семинара, мастер-класс, консультирование, курсовое проектирование.

Программой дисциплины предусмотрены следующие виды контроля: текущий контроль успеваемости в форме тестирования и защиты курсового проекта, промежуточный контроль в форме зачета.

Общая трудоемкость освоения дисциплины составляет 3 зачетные единицы, 108 ч. Программой дисциплины предусмотрены лекционные (36 часов) и семинарские (18 часов) занятия и 54 ч. самостоятельной работы студента.