

МИНОБРНАУКИ РОССИИ



Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

**«Российский государственный гуманитарный университет»
(ФГБОУ ВО «РГГУ»)**

ИНСТИТУТ ЭКОНОМИКИ, УПРАВЛЕНИЯ И ПРАВА

ЭКОНОМИЧЕСКИЙ ФАКУЛЬТЕТ

Кафедра Финансов и кредита

СТАНДАРТЫ РИСК-МЕНЕДЖМЕНТА

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

38.05.01 – «Экономическая безопасность»

специализация «Экономическая безопасность хозяйствующего субъекта»

Уровень высшего образования: специалитет

Формы обучения очная, очно-заочная, заочная

РПД адаптирована для лиц
с ограниченными возможностями
здоровья и инвалидов

Москва 2023

СТАНДАРТЫ РИСК-МЕНЕДЖМЕНТА

Рабочая программа дисциплины

Составитель:

К.э.н., доцент кафедры финансы и кредит Гуковская А.А.

УТВЕРЖДЕНО

Протокол заседания кафедры

№ 6 от 13 апреля 2023 года

ОГЛАВЛЕНИЕ

1.	ПОЯСНИТЕЛЬНАЯ ЗАПИСКА.....	4
1.1	Цель и задачи дисциплины.....	4
1.2	Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с индикаторами достижения компетенций.....	4
1.3	Место дисциплины в структуре образовательной программы.....	4
2.	СТРУКТУРА ДИСЦИПЛИНЫ.....	5
3.	СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ.....	5
4.	ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ.....	6
5.	ОЦЕНКА ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ.....	6
5.1	Система оценивания.....	6
5.2	Критерии выставления оценки по дисциплине.....	7
5.3	Оценочные средства (материалы) для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине.....	8
6.	УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ.....	10
6.1	Список источников и литературы.....	10
6.2	Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» ...	10
6.3	Профессиональные базы данных и информационно-справочные системы.....	11
7	МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ.....	11
8.	Обеспечение образовательного процесса для лиц с ограниченными возможностями здоровья И ИНВАЛИДОВ.....	11
9.	МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ.....	12
9.1	Планы семинаров.....	12
	ПРИЛОЖЕНИЕ 1 Аннотация рабочей программы дисциплины.....	15

1. ПОЯСНИТЕЛЬНАЯ ЗАПИСКА

1.1 Цель и задачи дисциплины

Цель дисциплины состоит в формировании у студентов целостной системы знаний об актуальных стандартах в области риск-менеджмента и их использовании в корпоративной практике.

Задачи дисциплины:

- сформировать базовые знания в области стандартов риск-менеджмента;
- изучить основные международные и национальные стандарты риск-менеджмента;
- изучить основные целевые показатели эффективности систем риск-менеджмента в компании.

1.2 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с индикаторами достижения компетенций

Компетенция (код и наименование)	Индикаторы компетенций (код и наименование)	Результаты обучения
ПК-2 Способен создавать интегрированную систему управления рисками в организации, разрабатывать нормативные и методические документы для координации процесса управления рисками	ПК-2.1. Анализирует и применяет нормативно-правовые акты в целях обеспечения экономической безопасности хозяйствующих субъектов	Знать: основные международные и национальные стандарты по риск-менеджменту; Уметь: анализировать системы риск-менеджмента компаний в соответствии с требованиями стандартов; Владеть: специальной терминологией в области риск-менеджмента и процессов стандартизации бизнес-процессов
ПК-3 Способен планировать и координировать деятельность организации по разработке стратегии и политики в области управления рисками, организовывать работу подразделений по управлению рисками	ПК-3.1. Проектирует, разрабатывает внутренние регламенты, обеспечивающие экономическую безопасность хозяйствующего субъекта	Знать: роль и место риск-менеджмента в структуре управления компанией; Уметь: выделять стратегические и тактические цели и задачи в области управления рисками Владеть: навыками написания документации по разработке/применению мер по управлению рисками в компании
	ПК-3.2. Осуществляет проверку существующих регламентов и разрабатывает рекомендации по их совершенствованию в целях повышения экономической безопасности	Знать: ключевые целевые показатели эффективности систем риск-менеджмента; Уметь: анализировать целевые показатели на соответствие нормативным значениям; Владеть: навыками проверки соответствия параметров функционирования компании целевым значениям

1.3 Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Стандарты риск-менеджмента» является частью блока дисциплин, формируемых участниками образовательных отношений учебного плана.

Для освоения дисциплины необходимы знания, умения и владения, сформированные в ходе изучения следующих дисциплин и прохождения практик: «Финансы», «Основы риск-менеджмента», «Аудит», «Бухгалтерский учет», «Экономическая статистика», «Теория вероятности и математическая статистика».

В результате освоения дисциплины формируются знания, умения и владения, необходимые для изучения следующих дисциплин: «Инвестиции и инвестиционный процесс», «Риск-менеджмент», «Финансовая безопасность организации» и прохождения преддипломной практики.

2. СТРУКТУРА ДИСЦИПЛИНЫ

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетных единицы, 108 часов.

Структура дисциплины для очной формы обучения

Объем дисциплины в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении учебных занятий:

Семестр	Тип учебных занятий	Количество часов
8	Лекции	16
8	Семинары/лабораторные работы	26
Всего:		42

Объем дисциплины в форме самостоятельной работы обучающихся составляет 66 академических часов.

Структура дисциплины для очно-заочной формы обучения

Объем дисциплины в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении учебных занятий:

Семестр	Тип учебных занятий	Количество часов
8	Лекции	12
8	Семинары/лабораторные работы	12
Всего:		24

Объем дисциплины в форме самостоятельной работы обучающихся составляет 84 академических часа.

Структура дисциплины для заочной формы обучения

Объем дисциплины в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении учебных занятий:

Семестр	Тип учебных занятий	Количество часов
8	Лекции	12
8	Семинары/лабораторные работы	12
Всего:		24

Объем дисциплины (модуля) в форме самостоятельной работы обучающихся составляет 84 академических часа.

3. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

№	Наименование раздела дисциплины	Содержание
1	Введение	Цели, задачи, структура и логика дисциплины, краткий обзор курса. Обзор специальной литературы, web – сайтов. Роль и место стандартов риск-менеджмента в современных финансах, практике компаний и банков
Раздел 1. Международные стандарты риск-менеджмента		
2	Тема 1	Эволюция процесса стандартизации в области риск-менеджмента. Основные этапы, факторы, определяющие развитие процессов стандартизации. Иерархия стандартов, институции их разрабатывающие
3	Тема 2.	Стандарт COSO II (ERM) (разработанный Комитетом спонсорских организаций Комиссии Тредвея, США, 2004 г.) Структура, особенности.
4	Тема 3.	Стандарт FERMA (разработан Федерацией европейских ассоциаций риск-менеджеров, 2002 г.). Структура, особенности
5	Тема 4.	Международный стандарт ISO 31000:2009. Структура, особенности, применение.
Раздел 2. Национальные стандарты риск-менеджмента		
6	Тема 5.	Российские стандарты риск-менеджмента. Обзор, эволюция, области применения, особенности
7	Тема 6.	ГОСТ Р ИСО 31000:2010. и ГОСТ 5 51897-2011. «Менеджмент риска. Термины и определения». Структура стандартов, особенности, связь с международными стандартами, развитие.
8	Тема 7	Практика применения стандартов риск-менеджмента российскими компаниями
Раздел 3. Банковские стандарты риск-менеджмента		
9	Тема 8.	Базель I–II. Основные положения, цели, методики. Границы применимости, проблемы
10	Тема 9.	Базель III Основные положения, цели, методики. Дальнейшая эволюция банковских стандартов в области риск-менеджмента

4. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

Для проведения учебных занятий по дисциплине используются различные образовательные технологии. Для организации учебного процесса может быть использовано электронное обучение и (или) дистанционные образовательные технологии.

5. ОЦЕНКА ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ

5.1 Система оценивания

<i>Форма контроля</i>	<i>Максимальное количество баллов</i>	
	<i>За 1 вид работы</i>	<i>Всего</i>
Решение практического кейса	5	10
Анализ кейса	4	12
Участие в дискуссии	2	18

Итоговое практическое задание	20	20
Промежуточная аттестация (зачет с оценкой)		40
Итого за семестр/дисциплину		100

Полученный совокупный результат конвертируется в традиционную шкалу оценок и в шкалу оценок Европейской системы переноса и накопления кредитов (European Credit Transfer System; далее – ECTS) в соответствии с таблицей:

100 балльная шкала	Традиционная шкала		Шкала ECTS
95 - 100	отлично	зачтено	A
83 - 94			B
68 - 82	хорошо		C
56 - 67	удовлетворительно		D
50 - 55		E	
20 - 49	неудовлетворительно	не зачтено	FX
0 - 19			F

5.2 Критерии выставления оценки по дисциплине

Баллы/ Шкала ECTS	Оценка по дисциплине	Критерии оценки результатов обучения по дисциплине
100-83/ А,В	«отлично»/ «зачтено (отлично)»/ «зачтено»	<p>Выставляется обучающемуся, если он глубоко и прочно усвоил теоретический и практический материал, может продемонстрировать это на занятиях и в ходе промежуточной аттестации.</p> <p>Обучающийся исчерпывающе и логически стройно излагает учебный материал, умеет увязывать теорию с практикой, справляется с решением задач профессиональной направленности высокого уровня сложности, правильно обосновывает принятые решения.</p> <p>Свободно ориентируется в учебной и профессиональной литературе.</p> <p>Оценка по дисциплине выставляется обучающемуся с учётом результатов текущей и промежуточной аттестации.</p> <p>Компетенции, закреплённые за дисциплиной, сформированы на уровне – «высокий».</p>
82-68/ С	«хорошо»/ «зачтено (хорошо)»/ «зачтено»	<p>Выставляется обучающемуся, если он знает теоретический и практический материал, грамотно и, по существу, излагает его на занятиях и в ходе промежуточной аттестации, не допуская существенных неточностей.</p> <p>Обучающийся правильно применяет теоретические положения при решении практических задач профессиональной направленности разного уровня сложности, владеет необходимыми для этого навыками и приёмами.</p> <p>Достаточно хорошо ориентируется в учебной и профессиональной литературе.</p> <p>Оценка по дисциплине выставляется обучающемуся с учётом результатов текущей и промежуточной аттестации.</p> <p>Компетенции, закреплённые за дисциплиной, сформированы на уровне – «хороший».</p>

Баллы/ Шкала ECTS	Оценка по дисциплине	Критерии оценки результатов обучения по дисциплине
67-50/ D,E	«удовлетворительно»/ «зачтено (удовлетворительно)»/ «зачтено»	<p>Выставляется обучающемуся, если он знает на базовом уровне теоретический и практический материал, допускает отдельные ошибки при его изложении на занятиях и в ходе промежуточной аттестации.</p> <p>Обучающийся испытывает определённые затруднения в применении теоретических положений при решении практических задач профессиональной направленности стандартного уровня сложности, владеет необходимыми для этого базовыми навыками и приёмами.</p> <p>Демонстрирует достаточный уровень знания учебной литературы по дисциплине.</p> <p>Оценка по дисциплине выставляется обучающемуся с учётом результатов текущей и промежуточной аттестации.</p> <p>Компетенции, закреплённые за дисциплиной, сформированы на уровне – «достаточный».</p>
49-0/ F,FX	«неудовлетворительно»/ не зачтено	<p>Выставляется обучающемуся, если он не знает на базовом уровне теоретический и практический материал, допускает грубые ошибки при его изложении на занятиях и в ходе промежуточной аттестации.</p> <p>Обучающийся испытывает серьёзные затруднения в применении теоретических положений при решении практических задач профессиональной направленности стандартного уровня сложности, не владеет необходимыми для этого навыками и приёмами.</p> <p>Демонстрирует фрагментарные знания учебной литературы по дисциплине.</p> <p>Оценка по дисциплине выставляется обучающемуся с учётом результатов текущей и промежуточной аттестации.</p> <p>Компетенции на уровне «достаточный», закреплённые за дисциплиной, не сформированы.</p>

5.3 Оценочные средства (материалы) для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

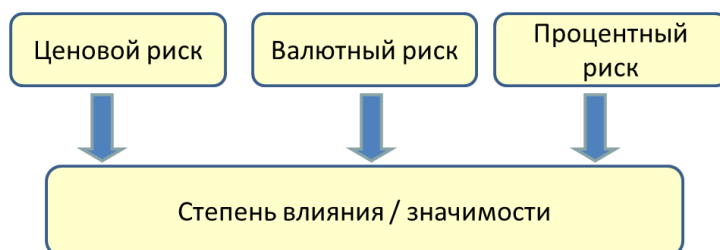
Контрольные вопросы:

1. Каковы основные этапы процесса стандартизации риск-менеджмента?
2. Каковы основные направления развития методов оценки рисков?
3. Что унифицируют стандарты риск-менеджмента?
4. Охарактеризуйте 8 основных компонентов стандарта COSO? В чем принципиальное отличие этого стандарта от других?
5. Что связывает между собой «куб COSO»?
6. Что такое риск-аппетит?
7. Как оцениваются риски по стандарту COSO?
8. Какие группы рисков выделяет стандарт FERMA?
9. Какие ключевые стадии процесс риск-менеджмента выделяет стандарт FERMA?
10. Каковы отличия построения системы управления рисками в России и мире?
11. Как определяют риск известные вам стандарты риск-менеджмента?
12. Охарактеризуйте модель управления риском в соответствии со стандартом ISO 31000. В чем ее особенности?
13. Какие принципа управления риском (стандарт ISO 31000) определяют его эффективность?

14. Какова роль государства в оценке рисков и процессе стандартизации риск-менеджмента?
15. Охарактеризуйте современные концепции управления рисками.
16. В чем заключается проблематика терминологии риск-менеджмента?
17. Опишите основные идеи и концепции, положенные в основу современных стандартов, разработанных профессиональными объединениями
18. Что означает один из принципов стандарта ISO 31000 «риск-менеджмент должен быть адаптируемым»?

Пример практического кейса

«Система корпоративного риск-менеджмента ГК Норникель»



	Pd	Pt	Ni	Cu	ЕВИТ Total (млн S)
Pd	1				
Pt	1	1			
Ni	0,415	0,415	1		
Cu	0,3062	0,3062	0,4193	1	
ЕВИТ Total (млн S)	0,1651	0,1651	0,1619	-0,106	1

Корреляция изменений выручки от реализации металлов с динамикой цен на металлы с 01.02.2012 по 01.02.2013.

	Курс S	ЕВИТ Total (млн S)
Курс S	1	
ЕВИТ Total (млн S)	0,0517	1

Корреляция изменений выручки от реализации металлов с динамикой курса валюты с 01.02.2012 по 01.02.2013.

На основании имеющихся данных (о корреляции между выручкой Норникеля и ценами на цветные металлы), других открытых данных обсудить источники основных рисков для компании.

Проанализировать положение об управлении рисками ГМНК

Источники информации:

- корпоративный сайт <https://ar2021.nornickel.ru/control-system-risk-management/risk-management/>;
- Отчеты по управлению рисками ГК Норникель: <https://ar2019.nornickel.ru/risks-and-control/risk-management>, <https://csr2021.nornickel.ru/ru/governance/risk-management/>
- Отчет об устойчивом развитии ГК Норникель https://www.akm.ru/upload/akmrating/Nornikel-sustainability-report_2020.pdf
- Биржевые цены на металлы
- Биржевые цены на стоимость акций компании

Вопросы для обсуждения:

- Какие стандарты риск-менеджмента положены в основу корпоративной политики в области управления рисками?

- Какие целевые показатели мониторинга менеджмента компании в контексте риск-менеджмента? С чем соотносятся?
- Как учтены экологические риски в системе управления рисками компании? Насколько эффективна существующая модель?

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

6.1 Список источников и литературы

Литература

Основная

1. Домашенко, Д. В. Современные подходы к корпоративному риск-менеджменту: методы и инструменты / Д. В. Домашенко, Ю. Ю. Финогенова. - Москва: Магистр : ИНФРА-М, 2019. - 304 с: – Режим доступа: <https://znanium.com/catalog/document?id=337083>

Дополнительная

1. Соколов Д. В. Базисная система риск-менеджмент организаций реального сектора экономики [Электронный ресурс]: Монография. – М.: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2019. - 126 с. ЭБС ZNANIUM Режим доступа: <https://new.znanium.com/read?id=288146>

6.2 Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

1. Международный Стандарт ISO 31000 Риск-менеджмент — Принципы и руководства [Электронный ресурс]. – Режим доступа: [http://www.pqm-online.com/assets/files/lib/std/iso_31000-2009\(r\).pdf](http://www.pqm-online.com/assets/files/lib/std/iso_31000-2009(r).pdf)
2. Управление рисками организаций. Интегрированная модель, сентябрь 2004 COSO ERM The Committee of Sponsoring Organizations of the Treadway Commission [Электронный ресурс] Режим доступа: http://www.valtars.ru/files/upload/Actual_info/coso_upravlenie_riskami_organizacii_integrirovannaya_model.pdf
3. Национальный стандарт Российской Федерации «Менеджмент риска. Принципы и руководство» ГОСТ Р ИСО 31000-2019 [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <https://docs.cntd.ru/document/1200170125>
4. Стандарты управления рисками Federation of Risk Management Associations (FERMA) [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.ferma.eu>
5. Международная конвергенция измерения капитала и стандартов капитала: Пересмотренные подходы – Полная Версия (International Convergence of Capital Measurement and Capital Standards: A Revised Framework – Comprehensive version, Basel Committee on Banking Supervision, июнь 2006), пер. с англ., Банк Международных Расчетов, 2006. <https://www.cbr.ru/Content/Document/File/36682/1.pdf>
6. Банк России [Электронный ресурс]: Электрон. дан. – Режим доступа: <http://www.cbr.ru/analytics/>
7. Сайт Базельского комитета по банковскому надзору (публикации) [Электронный ресурс] Режим доступа www.bis.org/publ/
8. COSO (The Committee of Sponsoring of the Treadway Commission) [Электронный ресурс] Режим доступа www.coso.org

9. GARP [Электронный ресурс] Режим доступа www.garp.com.
10. Русское общество управления рисками [Электронный ресурс] Режим доступа: <http://www.ferma.eu/app/uploads/2011/11/a-risk-managementstandard-russian-version.pdf>
11. Базовый стандарт управления рисками и внутреннего контроля участника финансового рынка — члена СРО ПАРТАД [Электронный ресурс] – Режим доступа <http://www.partad.ru/materialy/all/insurance/>
12. <https://www.standards.ru/document/4683329.aspx>

Национальная электронная библиотека (НЭБ) www.rusneb.ru
 ELibrary.ru Научная электронная библиотека www.elibrary.ru
 ProQuest Dissertation & Theses Global
 JSTOR

6.3 Профессиональные базы данных и информационно-справочные системы

Доступ к профессиональным базам данных: <https://liber.rsuh.ru/ru/bases>

Информационные справочные системы:

1. Консультант Плюс
2. Гарант

7 МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Для обеспечения дисциплины используется материально-техническая база образовательного учреждения: учебные аудитории, оснащённые компьютером и проектором для демонстрации учебных материалов.

Состав программного обеспечения:

1. Windows
2. Microsoft Office
3. Kaspersky Endpoint Security

8. ОБЕСПЕЧЕНИЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ДЛЯ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ И ИНВАЛИДОВ

В ходе реализации дисциплины используются следующие дополнительные методы обучения, текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся в зависимости от их индивидуальных особенностей:

- для слепых и слабовидящих: лекции оформляются в виде электронного документа, доступного с помощью компьютера со специализированным программным обеспечением; письменные задания выполняются на компьютере со специализированным программным обеспечением или могут быть заменены устным ответом; обеспечивается индивидуальное равномерное освещение не менее 300 люкс; для выполнения задания при необходимости предоставляется увеличивающее устройство; возможно также использование собственных увеличивающих устройств; письменные задания оформляются увеличенным шрифтом; экзамен и зачёт проводятся в устной форме или выполняются в письменной форме на компьютере.

- для глухих и слабослышащих: лекции оформляются в виде электронного документа, либо предоставляется звукоусиливающая аппаратура индивидуального

пользования; письменные задания выполняются на компьютере в письменной форме; экзамен и зачёт проводятся в письменной форме на компьютере; возможно проведение в форме тестирования.

- для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата: лекции оформляются в виде электронного документа, доступного с помощью компьютера со специализированным программным обеспечением; письменные задания выполняются на компьютере со специализированным программным обеспечением; экзамен и зачёт проводятся в устной форме или выполняются в письменной форме на компьютере.

При необходимости предусматривается увеличение времени для подготовки ответа.

Процедура проведения промежуточной аттестации для обучающихся устанавливается с учётом их индивидуальных психофизических особенностей. Промежуточная аттестация может проводиться в несколько этапов.

При проведении процедуры оценивания результатов обучения предусматривается использование технических средств, необходимых в связи с индивидуальными особенностями обучающихся. Эти средства могут быть предоставлены университетом, или могут использоваться собственные технические средства.

Проведение процедуры оценивания результатов обучения допускается с использованием дистанционных образовательных технологий.

Обеспечивается доступ к информационным и библиографическим ресурсам в сети Интернет для каждого обучающегося в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

- для слепых и слабовидящих: в печатной форме увеличенным шрифтом, в форме электронного документа, в форме аудиофайла.

- для глухих и слабослышащих: в печатной форме, в форме электронного документа.

- для обучающихся с нарушениями опорно-двигательного аппарата: в печатной форме, в форме электронного документа, в форме аудиофайла.

Учебные аудитории для всех видов контактной и самостоятельной работы, научная библиотека и иные помещения для обучения оснащены специальным оборудованием и учебными местами с техническими средствами обучения:

- для слепых и слабовидящих: устройством для сканирования и чтения с камерой SARA CE; дисплеем Брайля PAC Mate 20; принтером Брайля EmBraille ViewPlus;

- для глухих и слабослышащих: автоматизированным рабочим местом для людей с нарушением слуха и слабослышащих; акустический усилитель и колонки;

- для обучающихся с нарушениями опорно-двигательного аппарата: передвижными, регулируемые эргономическими партами СИ-1; компьютерной техникой со специальным программным обеспечением.

9. МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ

9.1 Планы семинаров

Тема 3 Стандарт ISO 31000:2009

1. Основные конструктивные элементы стандарта
2. Архитектура системы риск-менеджмента
3. Преимущества и недостатки (практика применения)

Список литературы:

1. Международный Стандарт ISO 31000 Риск-менеджмент — Принципы и руководства [Электронный ресурс]. – Режим доступа: [http://www.pqm-online.com/assets/files/lib/std/iso_31000-2009\(r\).pdf](http://www.pqm-online.com/assets/files/lib/std/iso_31000-2009(r).pdf)

Тема 4 Стандарт FERMA

4. Основные конструктивные элементы стандарта
5. Архитектура системы риск-менеджмента
6. Преимущества и недостатки (практика применения)

Список литературы:

1. Стандарты управления рисками Federation of Risk Management Associations (FERMA) [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.ferma.eu>
2. Русское общество управления рисками [Электронный ресурс] Режим доступа: <http://www.ferma.eu/app/uploads/2011/11/a-risk-managementstandard-russian-version.pdf>

Тема 5 Стандарт COSO II (ERM)

7. Основные конструктивные элементы стандарта
8. Архитектура системы риск-менеджмента
9. Преимущества и недостатки (практика применения)

Список литературы:

Тема 6 Анализ российских стандартов по риск-менеджменту

Вопросы для обсуждения:

1. Структура стандартов, особенности, связь с международными стандартами
2. Преимущества, недостатки
3. Кейсы по внедрению и использованию

Список литературы:

4. Национальный стандарт Российской Федерации «Менеджмент риска. Принципы и руководство» ГОСТ Р ИСО 31000-2019 [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <https://docs.cntd.ru/document/1200170125>

Тема 7 Практика российских компаний в применении стандартов риск-менеджмента

Вопросы для обсуждения:

1. Анализ кейсов, дискуссия

Список литературы

2. Домашенко, Д. В. Современные подходы к корпоративному риск-менеджменту: методы и инструменты / Д. В. Домашенко, Ю. Ю. Финогенова. - Москва: Магистр : ИНФРА-М, 2019. - 304 с: – Режим доступа: <https://znanium.com/catalog/document?id=337083>

Темы 8–9 Базельские соглашения как стандарты банковского риск-менеджмента

Вопросы для обсуждения:

1. Структура Базельских соглашений, основная цель

2. Связь требований к капиталу банков и рисками; позиция регуляторов
3. Стандарты Базель 3+ - что изменилось?

Список литературы

1. Международная конвергенция измерения капитала и стандартов капитала: Пересмотренные подходы – Полная Версия (International Convergence of Capital Measurement and Capital Standards: A Revised Framework – Comprehensive version, Basel Committee on Banking Supervision, июнь 2006), пер. с англ., Банк Международных Расчетов, 2006.
<https://www.cbr.ru/Content/Document/File/36682/1.pdf>
2. Банк России [Электронный ресурс]: Электрон. дан. – Режим доступа: <http://www.cbr.ru/analytics/>
3. Сайт Базельского комитета по банковскому надзору (публикации) [Электронный ресурс] Режим доступа www.bis.org/publ/

ПРИЛОЖЕНИЕ 1 Аннотация рабочей программы
дисциплины

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина «Стандарты риск-менеджмента» реализуется на экономическом факультете ИУЭП РГГУ кафедрой «Финансы и кредит».

Цель дисциплины состоит в формировании у студентов целостной системы знаний об актуальных стандартах в области риск-менеджмента и их использовании в корпоративной практике.

Задачи дисциплины:

- сформировать базовые знания в области стандартов риск-менеджмента;
- изучить основные международные и национальные стандарты риск-менеджмента;
- изучить основные целевые показатели эффективности систем риск-менеджмента в компании;

Дисциплина направлена на формирование у выпускника следующих компетенций:

- ПК-2 Способен создавать интегрированную систему управления рисками в организации, разрабатывать нормативные и методические документы для координации процесса управления рисками.
- ПК-3 Способен планировать и координировать деятельность организации по разработке стратегии и политики в области управления рисками, организовывать работу подразделений по управлению рисками.

В результате освоения данной дисциплины обучающийся должен:

Знать:

- основные международные и национальные стандарты по риск-менеджменту;
- роль и место риск-менеджмента в структуре управления компанией;
- ключевые целевые показатели эффективности систем риск-менеджмента.

Уметь:

- анализировать системы риск-менеджмента компаний в соответствии с требованиями стандартов;
- выделять стратегические и тактические цели и задачи в области управления рисками;
- анализировать целевые показатели на соответствие нормативным значениям.

Владеть:

- специальной терминологией в области риск-менеджмента и процессов стандартизации бизнес-процессов;
- навыками написания документации по разработке/применению мер по управлению рисками в компании;
- навыками проверки соответствия параметров функционирования компании целевым значениям.

По дисциплине предусмотрена промежуточная аттестация в виде зачета с оценкой.

Общая трудоемкость освоения дисциплины составляет 3 зачетных единицы, 108 часов.