Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
Московский государственный университет имени М.В. Ломоносова
Высшая школа управления и инноваций

УТВЕРЖДАЮ
и.о.декана
/В.В.Печковская /
«12» февраля 2019 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ

МАГИСТРАТУРА

27.04.05 "ИННОВАТИКА"

Форма обучения:

очная, очно-заочная

Рабочая программа рассмотрена и одобрена
Советом факультета

(протокол № 2, 12 февраля 2019 г.)

Москва 2019

Рабочая программа дисциплины (модуля) разработана в соответствии с самостоятельно установленным МГУ образовательным стандартом (ОС МГУ) для реализуемых основных профессиональных образовательных программ высшего образования по направлению подготовки / специальности 38.04.02 «Менеджмент» (программы магистратуры) в редакции приказа МГУ от 30 декабря 2016 г.

Год (годы) приема на обучение: 2017, 2018, 2019.

1. Место дисциплины (модуля) в структуре ОПОП ВО. Относится к профессиональному блоку вариативной части (дисциплины по выбору студента), реализуется на 2 году обучения.
2. Входные требования для освоения дисциплины (модуля), предварительные условия (если есть): освоение дисциплины «Моделирование и количественные методы анализа в бизнесе», «Управленческая экономика», «Системный анализ и теория принятия решений», «Стратегический менеджмент», «Финансовый менеджмент в высокотехнологичных отраслях».
3. Результаты обучения по дисциплине (модулю), соотнесенные с требуемыми компетенциями выпускников.

Компетенции выпускников, формируемые (полностью или частично) при реализации дисциплины (модуля):

УК-2. Готовность к саморазвитию, самореализации, использованию творческого потенциала.
УК-3. Готовность действовать в нестандартных ситуациях, нести социальную и этическую ответственность за принятые решения.
ОПК-3. Способность решать профессиональные задачи на основе философии, математических методов и моделей для управления инновациями, компьютерных технологий в инновационной сфере.
ОПК-4. Способность к абстрактному мышлению, анализу, синтезу.
ПК-3. Способность произвести оценку экономического потенциала инновации, затрат на инновационный проект и осуществление инновационной деятельности в организации.
ПК-4. Способность разработать план и программу организации инновационной деятельности научно-производственного подразделения, осуществлять технико-экономическое обоснование инновационных проектов и программ.
ПК-10. Способность критически анализировать современные проблемы инноватики с учётом экономического, социального, экологического и технологического аспектов жизнедеятельности человека.

В результате изучения дисциплины студент должен:
Знать:
- основные положения стандартов, устанавливающих правила работы с рискам в организации;
- историю развития и перспективные направления развития риск менеджмента в мире и в России;
- различия между управляемыми и неуправляемыми рисками.

Уметь:
- составлять карту рисков;
- формировать план противорисковых мероприятий;
- оценивать как краткосрочные результаты, так и стратегические результаты внедрения системы риск менеджмента;
- применять методы анализа рисков и негативных событий в области новых и высоких технологий;
- применять актуальные методы оценки рисков инновационных проектов при неполной статистической базе;

– оценивать актуальность рисковых событий на разных временных горизонтах с учётом особенностей стадии развития нового проекта.

Владеть:

– навыками количественной оценки рисков;
– навыками анализа бизнес-процессов организации с точки зрения исследования рисковых событий;
– навыками формирования резервов, как из прибыли, так и из потока денежных средств.

Иметь опыт построения реестра рисков инновационного проекта.

4. Формат обучения: очная, очно-заочная.

5. Объем дисциплины (модуля) составляет 3 з.е., в том числе 24 академических часов, отведенных на контактную работу обучающихся с преподавателем, 84 академических часов на самостоятельную работу обучающихся.

6. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и виды учебных занятий:

Разделы дисциплин и виды занятий (ак. часы)

Наименование и краткое содержание разделов и дисциплины (модуля), **Форма промежуточной аттестации по дисциплине (модулю)**	**Всего (часы)**	В том числе			
		Контактная работа (работа во взаимодействии с преподавателем) Виды контактной работы, часы			**Самостоятельная работа обучающегося, часы**
		Занятия лекционного типа*	Занятия семинарского типа*	**Всего**	
Тема 1. Риски в современном бизнесе Качественное и количественное понимание рисков. Риски: положительная и негативная сторона прогнозов. Риски: управление гибкостью (реактивной и проактивной). Риски бизнес процессов и риски активов.	**13**	**1**	**2**	**3**	10 Реферат Опрос (собеседование) Домашнее задание: «Риски: угрозы и шансы для технологического бизнеса»
Тема 2. Классификация рисков Общеэкономические и политические риски (риски окружающей среды). Риски бизнес-процессов: виды и причины возникновения. Операционный риск – эффективность, результативность управления инвестициями. Управленческий	**15**	**1**	**2**	**3**	12 Опрос (собеседование) Домашнее задание (сквозное, часть 1) Анализ рисков 3 российских публичных компаний и 3

риск – незнание основ управления рисками, незаконные действия со стороны управляющего компанией. Риск информационных технологий – несоответствие информационных технологий компетенциям компании. Риск лояльности – мошенничество. Финансовый рыночный риск – ликвидность, концентрация кредитных ресурсов, изменение кредитной политики банков. Риски, связанные с информацией для принятия решений. Операционный риск – неадекватность ключевых показателей деятельности. Финансовый риск (текущий) – неадекватное бюджетирование и неоптимальное налогообложение. Стратегический риск – неадекватная оценка стоимости бизнес-модели.					китайских публичных компаний технологического сектора
Тема 3. Оценка рисков. Количественный анализ рисков Анализ рисков, их приоритизация. VaR (Value at Risk) как инструмент для оценки и принятия краткосрочных решений. ROV (Real Options Valuation) как инструмент для оценки и принятия долгосрочных решений в отношении инвестиционных проектов. Применение дерева решений для принятия стратегических решений по развитию.	**13**	**1**	**2**	**3**	10 Опрос (собеседование) Домашнее задание (сквозное, часть 2) Расчет показателей риска 3 российских публичных компаний и 3 китайских публичных компаний технологического сектора
Тема 4. Карта рисков как инструмент анализа и контроля рисков Назначение и структура карты рисков. Примеры составления карт для различных отраслей. Реестр рисков производственной компании. Составление базы произошедших рисковых	**16**	**1**	**3**	**4**	12 Опрос (собеседование) Домашнее задание. Построение карты рисков 1 российской и 1

событий. Актуализация базы рисков: ежегодная и ежеквартальная. Процедуры и ответственные лица.					китайской компании сектора биотехнологий
Тема 5. Модель управления бизнес-рисками Структура модели и анализ бизнес-рисков. Разработка стратегий. Функционирование модели. Роль внутреннего аудита. Координация риск менеджмента и службы внутреннего контроля. Применение положений закона Сарбейнса Оксли в практике риск менеджмента международных компаний.	**16**	**1**	**3**	**4**	12 Опрос (собеседование) Домашнее задание. Анализ модели управления рисками компаний Ali baba, Ozon и Amazon
Тема 6. Управление рисками процесса с анализом последствий и причин Потенциальные риски процесса / функции/ требования, Значение и механизмы возникновения, Меры по предотвращению и обнаружению, Определение приоритетного числа риска и рекомендуемые мероприятия.	**16**	**1**	**3**	**4**	12 Тест по пройденной теме
Тема 7. Разработка противорисковых мероприятий Способы противодействия рискам. Избегание, Программы недопущения рисков. Мониторинг. Отсутствие действий (сознательное). Оценка управляющих последствий противорисковых мероприятий. Изменение вероятности наступления события. Расходы на недопущение риска, Особенности работы по рискам группы ПБиОТ и экология, Опыт российских компаний по риск-менеджменту.	**15**	**1**	**2**	**3**	12 Опрос (коллоквиум) Задание групповое. Разработка комплекса противорисковых мероприятий любой компании из сектора искусственного интеллекта КР
Промежуточная аттестация (зачёт)					**4**
Итого	**108**			**24**	**84**

7. Фонд оценочных средств (ФОС) для оценивания результатов обучения по дисциплине (модулю)

7.1. Типовые контрольные задания или иные материалы для проведения текущего контроля успеваемости.

7.1.1 Темы курсовых работ

Курсовая работа по дисциплине «Управление рисками» не предусмотрена.

7.1.2 Темы рефератов

1. Анализ структуры рисков компаний Яндекс и mail.ru.
2. Построение карты рисков на примере компаний «Институт стволовых клеток человека» и «Биокад».
3. Качественная сторона риска менеджмента.
4. Анализ статистических рядов для оценки риска.
5. Типы противорисковых мероприятий.
6. Формирование резервов как часть противорисковой программы.
7. Хеджирование как часть противорисковой программы.
8. ИТ безопасность как часть противорисковой программы.
9. Профилактика рисков ОТ и ТБ как часть противорисковой программы.
10. Ментальные ловушки управления рисками.
11. Риск аппетит: способы измерения и применения индивидуальных особенностей.

7.1.3 Вопросы для текущего контроля и самостоятельной работы студентов:

1. Качественное и количественное понимание рисков.
2. Риски: положительная и негативная сторона прогнозов.
3. Риски: управление гибкостью (реактивной и проактивной).
4. Риски бизнес процессов и риски активов.
5. Общеэкономические и политические риски (риски окружающей среды).
6. Риски бизнес-процессов: виды и причины возникновения.
7. Операционный риск – эффективность, результативность управления инвестициями.
8. Управленческий риск – незнание основ управления рисками, незаконные действия со стороны управляющего компанией.
9. Риск информационных технологий – несоответствие информационных технологий компетенциям компании.
10. Риск лояльности – мошенничество.
11. Финансовый рыночный риск – ликвидность, концентрация кредитных ресурсов, изменение кредитной политики банков.
12. Риски, связанные с информацией для принятия решений.
13. Операционный риск – неадекватность ключевых показателей деятельности.
14. Финансовый риск (текущий) – неадекватное бюджетирование и неоптимальное налогообложение.
15. Стратегический риск – неадекватная оценка стоимости бизнес-модели.
16. Анализ рисков, их приоритизация.
17. VaR (Value at Risk) как инструмент для оценки и принятия краткосрочных решений.
18. ROV (Real Options Valuation) как инструмент для оценки и принятия долгосрочных решений в отношении инвестиционных проектов.
19. Применение дерева решений для принятия стратегических решений по развитию.
20. Назначение и структура карты рисков.
21. Примеры составления карт для различных отраслей.
22. Реестр рисков производственной компании.
23. Составление базы произошедших рисковых событий.

24. Актуализация базы рисков: ежегодная и ежеквартальная.
25. Процедуры и ответственные лица.
26. Структура модели и анализ бизнес-рисков.
27. Разработка стратегий.
28. Функционирование модели.
29. Роль внутреннего аудита.
30. Координация риск-менеджмента и службы внутреннего контроля.
31. Применение положений закона Сарбейнса Оксли в практике риск-менеджмента международных компаний.
32. Потенциальные риски процесса / функции/ требования, Значение и механизмы возникновения.
33. Меры по предотвращению и обнаружению, Определение приоритетного числа риска и рекомендуемые мероприятия.
34. Способы противодействия рискам.
35. Избегание, Программы недопущения рисков.
36. Мониторинг. Отсутствие действий (сознательное).
37. Оценка управляющих последствий противорисковых мероприятий.
38. Изменение вероятности наступления события,
39. Расходы на недопущение риска.
40. Особенности работы по рискам группы ПБиОТ и экология.
41. Опыт российских компаний по риск-менеджменту.

7.1.4 Примеры контрольной работы

В 1

1. Проанализировать внешние риски для компании.
2. Посчитать VaR.
3. Выявить ключевые внутренние риски.

В 2

1. Проранжировать по приоритетам реестр рисков на срок год.
2. Посчитать стоимость реального опциона.
3. Рассчитать коэффициент замещения при страховании активов.

7.1.5 Примеры домашнего задания

1. Изучить опыт фонда LTCM. Проанализировать какие риски не были полноценно отражены в их модели бизнеса.
2. Изучить опыт компании Sumitomo. Проанализировать какие риски не были полноценно отражены в их модели бизнеса.
3. Изучить опыт компании Enron. Проанализировать какие риски не были полноценно отражены в их модели бизнеса.
4. Изучить опыт компании ЮКОС. Проанализировать какие риски не были полноценно отражены в их модели бизнеса.
5. Изучить опыт банка «Открытие». Проанализировать какие риски не были полноценно отражены в их модели бизнеса.

7.1.6 Пример теста для контроля знаний обучающихся

Выберите правильные ответы (правильных ответов может быть несколько):

1. Карта рисков включает:

a. Только внешние риски.
b. Только управляемые риски.
c. Все риски.

d. Только эндогенные риски.

2. Карта рисков включает:

a. Оценку стоимости ущерба.
b. Стратегический анализ.
c. Анализ управленческой вертикали.
d. Маркетинговый анализ.

3. Хеджирование позволяет уменьшить:

a. Стратегические риски.
b. Торгуемые риски.
c. Риски чрезвычайных событий.
d. Политические риски.

4. Страхование в страховой компании позволяет уменьшить:

a. Стратегические риски.
b. Торгуемые риски.
c. Риски чрезвычайных событий.
d. Политические риски.

5. Черный лебедь это событие, у которого:

a. Крайне малая вероятность и малый ущерб.
b. Крайне малая вероятность и высокий ущерб.
c. Высокая вероятность и малый ущерб.
d. Высокая вероятность и высокий ущерб.

6. Статистический анализ в оценке рисков строится на:

a. Статистической информации о прошлых событиях глубиной 1 месяц.
b. Статистической информации о прошлых событиях глубиной 5 лет.
c. Прогнозной информации о будущих событиях глубиной 1 месяц.
d. Прогнозной информации о будущих событиях глубиной 5 лет.

7. Диверсификация активов:

a. Снижает несистематический риск портфеля.
b. Снижает систематический риск портфеля.
c. Повышает несистематический риск портфеля.
d. Повышает систематический риск портфеля.

8. Концентрация активов:

a. Снижает несистематический риск портфеля.
b. Снижает систематический риск портфеля.
c. Повышает несистематический риск портфеля.
d. Повышает систематический риск портфеля.

9. Риск активов и доходность имеют на эффективном рынке зависимость:

a. Прямую.
b. Обратную.
c. Нет устойчивой взаимосвязи.
d. 1,5.

10. Управленческая гибкость как метод адаптации к рисковым непрогнозируемым событиям лучше работает, если:

a. Доля постоянных расходов высокая.
b. Доля переменных расходов высокая.
c. Доля амортизации высокая.
d. Доля рекламных расходов высокая.

11. Управленческая гибкость как метод адаптации к рисковым непрогнозируемым событиям лучше работает, если:

a. Доля долгов в структуре капитала высокая.
b. Доля долгов в структуре капитала низкая.
c. Доля долгов в структуре капитала 1,0.

d. Доля краткосрочных долгов в структуре капитала высокая.

12. Управленческая гибкость как метод адаптации к рисковым непрогнозируемым событиям лучше работает, если в компании:

a. Жесткая вертикальная управленческая вертикаль.
b. Рыхлая вертикальная управленческая вертикаль.
c. Плоская (горизонтальная) управленческая вертикаль.

13. Активное использование коррупционных связей как фактора повышает для компании:

a. Экзогенные риски.
b. Эндогенные риски.
c. Риски внешней среды.
d. Риски валютные.

14. Высокая склонность к риску у инвесторов обычно наблюдается:

a. В период экономического кризиса.
b. Сразу после окончания экономического кризиса.
c. Через 5 лет после окончания экономического кризиса.
d. При неолиберальном подходе к управлению.

15. Низкая склонность к риску у инвесторов обычно наблюдается:

a. В период экономического кризиса.
b. Сразу после окончания экономического кризиса.
c. Через 5 лет после окончания экономического кризиса.
d. При неолиберальном подходе к управлению.

16. Карта рисков выделяет красным цветом (наиболее актуальные) риски, у которых:

a. Высокая стоимость ущерба и длинный срок.
b. Высокая стоимость ущерба и короткий срок.
c. Низкая стоимость ущерба и длинный срок.
d. Низкая стоимость ущерба и короткий срок.

17. Активное применение противорисковых мероприятий приводит к:

a. Увеличению операционных расходов.
b. Снижению операционных расходов.
c. Увеличению налоговой нагрузки.
d. Снижению налоговой нагрузки.

18. Риск повышения процентных ставок по полученным кредитам:

a. Внешний.
b. Внутренний.
c. Управляемый.
d. Неуправляемый.

19. Риск мошенничества со стороны персонала:

a. Внешний.
b. Внутренний.
c. Управляемый.
d. Неуправляемый.

20. Риск наводнений / смерчей:

a. Внешний.
b. Внутренний.
c. Управляемый.
d. Неуправляемый.

7.2. Типовые контрольные задания или иные материалы для проведения промежуточной аттестации

7.2.1 Вопросы к зачёту

1. Определение понятия риск.
2. Внутренние риски компании.
3. Риски бизнес процессов.
4. Риски активов.
5. Событий анализ рисковых факторов.
6. Финансовые риски.
7. Стратегические риски.
8. Операционные риски.
9. Приоритизация рисков.
10. Анализ рисков, их приоритезация.
11. Стоимость под риском, VaR.
12. Проактивная и реактивная гибкость.
13. Применение ROV (реальные опционы) для управления рисками.
14. Применение дерева решений для принятия решения с учетом риска.
15. Реестр рисков компании.
16. Карта рисков. Примеры составления карт для различных отраслей.
17. Применение дерева решений для принятия стратегических решений по развитию.
18. Составление базы произошедших рисковых событий.
19. Актуализация базы рисков: ежегодная и ежеквартальная.
20. Процедуры и ответственные лица.
21. Структура модели и анализ бизнес-рисков.
22. Актуализация карты рисков: квартальная и месячная.
23. Роль внутреннего контроля в профилактике рисков.
24. Формирование риск ориентированной внутренней культуры в компании.
25. Разработка противорисковых мероприятий: формирование резервов.
26. Разработка противорисковых мероприятий: изменение ментальности сотрудников.
27. Разработка противорисковых мероприятий: страхование.
28. Разработка противорисковых мероприятий: хеджирование рисков.
29. Разработка противорисковых мероприятий: сознательное отсутствие действий
30. Связь риска и требуемой доходности: участие риск менеджмента в построении годовых бюджетов.
31. Связь риска и требуемой доходности: участие риск менеджмента в построении долгосрочных финансовых моделей.
32. Стоимость противорисковых мероприятий: оценка окупаемости принимаемых решений.
33. Меры по предотвращению и обнаружению, Определение приоритетного числа риска и рекомендуемые мероприятия.
34. Способы противодействия рискам.
35. Избегание, Программы недопущения рисков.
36. Мониторинг. Отсутствие действий (сознательное).
37. Оценка управляющих последствий противорисковых мероприятий.
38. Изменение вероятности наступления события.

7.2.2 Пример итогового теста

1. Карта рисков включает:

a. Только внешние риски.
b. Только управляемые риски.
c. Все риски.

d. Только эндогенные риски.

2. Карта рисков включает:

a. Оценку стоимости ущерба.
b. Стратегический анализ.
c. Анализ управленческой вертикали.
d. Маркетинговый анализ.

3. Хеджирование позволяет уменьшить:

a. Стратегические риски.
b. Торгуемые риски.
c. Риски чрезвычайных событий.
d. Политические риски.

4. Страхование в страховой компании позволяет уменьшить:

a. Стратегические риски.
b. Торгуемые риски.
c. Риски чрезвычайных событий.
d. Политические риски.

5. Черный лебедь это событие, у которого:

a. Крайне малая вероятность и малый ущерб.
b. Крайне малая вероятность и высокий ущерб.
c. Высокая вероятность и малый ущерб.
d. Высокая вероятность и высокий ущерб.

6. Статистический анализ в оценке рисков строится на:

a. Статистической информации о прошлых событиях глубиной 1 месяц,
b. Статистической информации о прошлых событиях глубиной 5 лет,
c. Прогнозной информации о будущих событиях глубиной 1 месяц.
d. Прогнозной информации о будущих событиях глубиной 5 лет.

7. Диверсификация активов:

a. Снижает несистематический риск портфеля.
b. Снижает систематический риск портфеля.
c. Повышает несистематический риск портфеля.
d. Повышает систематический риск портфеля.

8. Концентрация активов:

a. Снижает несистематический риск портфеля.
b. Снижает систематический риск портфеля.
c. Повышает несистематический риск портфеля.
d. Повышает систематический риск портфеля.

9. Риск активов и доходность имеют на эффективном рынке зависимость:

a. Прямую.
b. Обратную.
c. Нет устойчивой взаимосвязи.
d. 1,5.

10. Управленческая гибкость как метод адаптации к рисковым непрогнозируемым событиям лучше работает, если:

a. Доля постоянных расходов высокая.
b. Доля переменных расходов высокая.
c. Доля амортизации высокая.
d. Доля рекламных расходов высокая.

11. Управленческая гибкость как метод адаптации к рисковым непрогнозируемым событиям лучше работает, если:

a. Доля долгов в структуре капитала высокая.
b. Доля долгов в структуре капитала низкая.
c. Доля долгов в структуре капитала 1,0.

d. Доля краткосрочных долгов в структуре капитала высокая.

12. Управленческая гибкость как метод адаптации к рисковым непрогнозируемым событиям лучше работает, если в компании:

a. Жесткая вертикальная управленческая вертикаль.
b. Рыхлая вертикальная управленческая вертикаль.
c. Плоская (горизонтальная) управленческая вертикаль.

13. Активное использование коррупционных связей как фактора повышает для компании:

a. Экзогенные риски.
b. Эндогенные риски.
c. Риски внешней среды.
d. Риски валютные .

14. Высокая склонность к риску у инвесторов обычно наблюдается:

a. В период экономического кризиса.
b. Сразу после окончания экономического кризиса.
c. Через 5 лет после окончания экономического кризиса.
d. При неолиберальном подходе к управлению.

15. Низкая склонность к риску у инвесторов обычно наблюдается:

a. В период экономического кризиса.
b. Сразу после окончания экономического кризиса.
c. Через 5 лет после окончания экономического кризиса.
d. При неолиберальном подходе к управлению.

16. Карта рисков выделяет красным цветом (наиболее актуальные) риски, у которых:

a. Высокая стоимость ущерба и длинный срок.
b. Высокая стоимость ущерба и короткий срок.
c. Низкая стоимость ущерба и длинный срок.
d. Низкая стоимость ущерба и короткий срок.

17. Активное применение противорисковых мероприятий приводит к:

a. Увеличению операционных расходов.
b. Снижению операционных расходов.
c. Увеличению налоговой нагрузки.
d. Снижению налоговой нагрузки.

18. Риск повышения процентных ставок по полученным кредитам:

a. Внешний.
b. Внутренний.
c. Управляемый.
d. Неуправляемый.

19. Риск мошенничества со стороны персонала:

a. Внешний.
b. Внутренний.
c. Управляемый.
d. Неуправляемый.

20. Риск наводнений / смерчей:

a. Внешний.
b. Внутренний.
c. Управляемый.
d. Неуправляемый.

21. Главный риск, создающий риски при высокой долговой нагрузке это:

a. Низкая рентабельность бизнеса, недостаточная для обслуживания долгов.
b. Высокая дивидендная доходность.
c. Малые удельные капитальные затраты.
d. Кассовый разрывы бизнеса.

ШКАЛА И КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ результатов обучения (РО) по дисциплине (модулю)

Оценка / **РО и соответствующие виды оценочных средств**	2	3	4	5
Знания *(письменные опросы на каждом занятии и контрольные работ по темам)*	Отсутствие знаний	Фрагментарные знания	Общие, но не структурированные знания	Сформированные систематические знания
Умения *(практические контрольные задания, написание и защита рефератов на заданную тему и решение кейсов из текущей практики)*	Отсутствие умений	В целом успешное, но не систематическое умение	В целом успешное, но содержащее отдельные пробелы умение (допускает неточности непринципиального характера)	Успешное и систематическое умение
Навыки (владения, опыт деятельности) *(виды оценочных средств: отчет по практике, отчет по НИР, выполнение сценарного моделирования)*	Отсутствие навыков (владений, опыта)	Наличие отдельных навыков (наличие фрагментарного опыта)	В целом, сформированные навыки (владения), но используемые не в активной форме	Сформированные навыки (владения), применяемые при решении задач

8. Ресурсное обеспечение:

8.1.Перечень основной и дополнительной литературы

а) Основная литература:

1. Белов, П. Г. Системный анализ и программно-целевой менеджмент рисков: учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры [Текст] / П. Г. Белов. – М.: Издательство Юрайт, 2018. – 289 с.
2. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент: учебник [Текст] / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. – М.: Издательство Юрайт, 2018. – 365 с.
3. Жуковский, В. И. Оценка рисков и многошаговые позиционные конфликты: учебное пособие для вузов / В. И. Жуковский, М. Е. Салуквадзе. — 2-е изд., пер. и доп. – М.: Издательство Юрайт, 2018. – 305 с.

4. Основы риск-менеджмента [Текст] / Д. Гэлаи, М. Кроуи, В. Б. Минасян, Р. Марк. – М.: Издательство Юрайт, 2018. – 391 с.
5. Тимошенков, С. П. Надежность технических систем и техногенный риск: учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры [Текст] / С. П. Тимошенков, Б.М. Симонов, В.Н. Горошко. – М.: Издательство Юрайт, 2018. – 502 с.

б) Дополнительная литература:

1. ГОСТ Р 51901.5-2005 (МЭК 60300-3-1:2003) Менеджмент риска. Руководство по применению методов анализа надежности.
2. ГОСТ Р 51901.6-2005 (МЭК 61014:2003) Менеджмент риска. Программа повышения надежности.
3. ГОСТ Р 51901.11-2005 (МЭК 61882:2001) Менеджмент риска. Исследование опасности и работоспособности. Прикладное руководство
4. ГОСТ Р 51901.16-2005 (МЭК 61164:1995) Менеджмент риска. Повышение надежности. Статистические критерии и методы оценки.
5. Бартон, Т., Шенкир, У., Уокер, П. Риск-менеджмент. Практика ведущих компаний [Текст] / Т. Бартон, У. Шенкир, П. Уокер, – М.: Вильямс, 2015, – 208 с.
6. Шоломицкий, А.Г. Теория риска. Выбор при неопределенности и моделирование риска [Текст] / А.Г. Шоломицкий. – М.: Высшая школа экономики, 2005, – 400 с.
7. Пименов, Н.А. Управление финансовыми рисками в системе экономической безопасности: учебник и практикум для академического бакалавриата [Текст] / Н.А. Пименов. / Н. А. Пименов. – 2-е изд., пер. и доп. – М.: Издательство Юрайт, 2018. – 326 с.

8.1 Перечень лицензионного программного обеспечения (при необходимости):

MS Office

8.2 Перечень профессиональных баз данных и информационных справочных систем

1. Федеральная служба государственной статистики: сайт. – URL: https://www.gks.ru
2. Центральный банк Российской Федерации: сайт. – URL: https://cbr.ru
3. ЭБС «Юрайт» [раздел «ВАША ПОДПИСКА: учебники и учебные пособия издательства «Юрайт»]: сайт. – URL: https://www.biblio-online.ru/catalog/
4. ЭБС издательства «Лань» [учебные, научные издания, первоисточники, художественные произведения различных издательств; журналы] : сайт. – URL: http://e.lanbook.com
5. Электронная библиотека экономического факультета МГУ – URL: https://www.econ.msu.ru/elibrary

8.3. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (при необходимости)

1. https://www.bloomberg.com – информационное агентство «Блумберг».
2. https://www.cfin.ru – интернет проект «Корпоративный менеджмент».
3. https://www.cfjournal.hse.ru – электронный журнал «Корпоративные финансы».
4. https://www.fd.ru – журнал «Финансовый директор».
5. https://www.econ.msu.ru/elibrary – Электронная библиотека экономического факультета МГУ.
6. https://www.mckinsey.com/quarterly журнал «Вестник МакКинзи».

8.3 Описание материально-технического обеспечения.

Для проведения образовательного процесса необходима аудитория, оборудованная компьютером и проектором, необходимыми для демонстрации презентаций. Обязательное программное обеспечение – MS Office.

9. Язык преподавания.

Русский.

10. Преподаватель (преподаватели).

Волков Юрий Владимирович, ст.преподаватель ВШУИ МГУ

11. Автор (авторы) программы.

Волков Юрий Владимирович, ст.преподаватель ВШУИ МГУ