

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Макаренко Елена Николаевна

Должность:

Документ подписан в:

Дата подписания: 21.06.2026 15:48:28

Уникальный программный ключ:

c098bc0c1041cb2a4cf926cf171d6715d99a6ae00adc8e27b55cbe1e2dbd7c78

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования

«Ростовский государственный экономический университет (РИНХ)»

УТВЕРЖДАЮ

Начальник

учебно-методического управления

Т.К. Платонова

«25» мая 2026 г.

**Рабочая программа дисциплины  
Риск-менеджмент в стратегическом управлении**

Направление подготовки

38.03.02 Менеджмент

Направленность (профиль) программы бакалавриата  
38.03.02.20 Стратегическое управление предприятием

Для набора 2026 года

Квалификация  
Бакалавр

**КАФЕДРА      Общий и стратегический менеджмент****Распределение часов дисциплины по семестрам / курсам**

Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	<b>9 (5.1)</b>		Итого	
	15 5/6			
Неделя				
Вид занятий	УП	РП	УП	РП
Лекции	6	6	6	6
Лабораторные	6	6	6	6
Итого ауд.	12	12	12	12
Контактная работа	12	12	12	12
Сам. работа	123	123	123	123
Часы на контроль	9	9	9	9
Итого	144	144	144	144

**ОСНОВАНИЕ**

Учебный план утвержден учёным советом Университета (протокол № 9 от 03.03.2026 г.).

Программу составил(и): к.э.н., доцент, Гончарова С.Н.

Зав. кафедрой: к.э.н., доцент С.Н. Гончарова

Методический совет: д.э.н., доцент М.А. Суржиков

### 1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1	формирование у студентов системных теоретических знаний и практических компетенций в области идентификации, анализа, оценки и управления стратегическими рисками, необходимых для разработки эффективных стратегий и программ развития организации, а также для осуществления стратегического планирования и управления предприятием, бизнес-процессами и проектами в условиях неопределенности и динамично изменяющейся среды.
-----	---

### 2. ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

**ПК-2. Способен осуществлять стратегическое планирование и управлять предприятиями, бизнес-процессами и проектами с учетом факторов риска в условиях изменяющейся среды**

**ПК-1. Способен разрабатывать стратегии и программы развития организации, осуществлять мониторинг и контроль их реализации**

#### В результате освоения дисциплины обучающийся должен:

**Знать:**

- теоретические основы и методологию идентификации, оценки и реагирования на риски, возникающие при разработке и реализации стратегий и программ развития организации (соотнесено с индикатором ПК-1.1).
- методы стратегического планирования и модели управления предприятием, бизнес-процессами и проектами, позволяющие учитывать факторы риска и неопределенности в условиях динамично изменяющейся среды (соотнесено с индикатором ПК-2.1).

**Уметь:**

- разрабатывать стратегии и программы развития с учетом факторов неопределенности, а также осуществлять мониторинг ключевых индикаторов риска для своевременной корректировки планов (соотнесено с индикатором ПК-1.2).
- осуществлять стратегическое планирование деятельности предприятия, выстраивать бизнес-процессы и управлять проектами, интегрируя процедуры идентификации, оценки и минимизации рисков на всех этапах их жизненного цикла (соотнесено с индикатором ПК-2.2).

**Владеть:**

- методами контроля реализации стратегических решений и навыками внесения корректирующих воздействий в программы развития при отклонении фактических показателей риска от запланированных (соотнесено с индикатором ПК-1.3).
- навыками адаптивного управления предприятием, бизнес-процессами и проектами, обеспечивающими своевременную корректировку стратегических планов при изменении профиля риска внешней и внутренней среды (соотнесено с индикатором ПК-2.3).

### 3. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

#### Раздел 1. Риск в системе стратегического управления

№	Наименование темы, краткое содержание	Вид занятия / работы / форма ПА	Семестр / Курс	Количество часов	Компетенции
1.1	Понятие и сущность стратегических рисков в системе стратегического управления Вероятность отклонения от стратегических целей, неопределенность внешней и внутренней среды, интеграция риск-менеджмента в стратегическое управление, сквозной процесс управления рисками, риск как фактор потери конкурентных преимуществ, связь риска и доходности, риск-аппетит организации, проактивное vs реактивное управление рисками, место риск-менеджмента в цикле стратегического планирования, выявление возможностей через управление рисками.	Лекционные занятия	9	2	ПК-2 ПК-1
1.2	Идентификация стратегических рисков с использованием PEST и SWOT-анализа Применение PEST-анализа для выявления макроэкономических, политических, социальных и технологических угроз внешней среды. Проведение SWOT-анализа с фокусом на сопоставление слабых сторон организации и внешних угроз (матрица «слабости — угрозы»). Формирование структурированного реестра стратегических рисков на основе результатов качественного анализа конкретного бизнес-кейса.	Лабораторные занятия	9	2	ПК-2 ПК-1
1.3	Классификация стратегических рисков предприятия и факторы их возникновения Внешние и внутренние стратегические риски, геополитические и макроэкономические риски, социально-демографические и технологические риски, правовые и регуляторные риски, управленческие и ресурсные риски, операционные и финансовые риски, инновационные и репутационные риски, факторы возникновения: нестабильность законодательства, действия	Самостоятельная работа	9	6	ПК-2 ПК-1

	конкурентов, ошибки топ-менеджмента, изменение потребительских предпочтений, сбой в цепочках поставок, классификация как основа выбора методов управления.				
1.4	Количественная оценка рисков: анализ чувствительности и сценарное моделирование Построение таблиц анализа чувствительности для определения критических факторов, влияющих на NPV, ROI и EBITDA стратегического решения. Разработка трех сценариев развития событий (оптимистичный, базовый, пессимистичный) с расчетом разброса возможных результатов. Оценка вероятностных распределений ключевых показателей эффективности при различных сочетаниях факторов риска.	Самостоятельная работа	9	7	ПК-2 ПК-1
1.5	Методология идентификации и анализа стратегических рисков PEST-анализ для сканирования макросреды, SWOT-анализ для сопоставления угроз и возможностей, сценарное планирование альтернативных вариантов будущего, метод «дерева решений» для структурирования выбора, мозговой штурм и метод Дельфи, интервью с экспертами и опросы ключевых стейкхолдеров, анализ цепочек создания стоимости (Value Chain), карты рисков и реестры рисков, выявление латентных рисков, качественный анализ как первый этап оценки.	Самостоятельная работа	9	6	ПК-2 ПК-1
1.6	Построение стратегической карты рисков и определение риск-аппетита Ранжирование идентифицированных рисков по двум осям (вероятность наступления и степень влияния на стратегические цели). Построение тепловой карты рисков (heat map) с выделением зон критических, высоких, средних и низких рисков. Определение риск-аппетита организации как количественно выраженного уровня риска, допустимого для достижения целевой доходности.	Самостоятельная работа	9	4	ПК-2 ПК-1
1.7	Количественные методы оценки стратегических рисков Анализ чувствительности ключевых показателей, определение критических факторов риска, имитационное моделирование Монте-Карло, вероятностное распределение результатов, стресс-тестирование экстремальных сценариев, расчет Value at Risk (VaR), ожидаемые и неожиданные потери, анализ сценариев «что если», деревья событий и деревья отказов, пост-ретроспективный анализ точности оценок.	Самостоятельная работа	9	4	ПК-2 ПК-1
1.8	Разработка стратегии и программы развития с интеграцией риск-факторов Формирование альтернативных стратегических вариантов с оценкой риск-профиля каждого варианта. Выбор оптимальной стратегии на основе критерия «доходность — риск» с учетом риск-аппетита организации. Включение в программу развития раздела о ключевых рисках, планах их минимизации и ответственных лицах.	Самостоятельная работа	9	4	ПК-2 ПК-1
1.9	Выбор методов управления стратегическими рисками (уклонение, снижение, передача, принятие) Применение уклонения от риска при отказе от стратегически опасных проектов или выходе с нестабильных рынков. Использование методов снижения риска: диверсификация продуктового портфеля, резервирование ресурсов и внедрение систем внутреннего контроля. Передача риска через страхование, аутсорсинг неключевых функций, хеджирование и договорное распределение ответственности. Принятие риска с созданием резервных фондов и контингент-планов.	Самостоятельная работа	9	4	ПК-2 ПК-1
1.10	Сравнительный анализ национальных и международных стандартов риск-менеджмента (COSO ERM, ISO 31000, ГОСТ Р ИСО 31000) Анализ структуры и ключевых принципов стандарта COSO ERM (Enterprise Risk Management) с фокусом на интеграцию рисков в стратегическое управление. Изучение стандарта ISO 31000: терминология, принципы, процессный подход к управлению рисками. Сравнение международных подходов с российским ГОСТ Р ИСО 31000, выявление различий в терминологии, этапах процесса и требованиях к документированию.	Самостоятельная работа	9	6	ПК-2 ПК-1
1.11	Поведенческие аспекты стратегического риск-менеджмента: когнитивные искажения при принятии решений Идентификация основных когнитивных искажений, влияющих на оценку стратегических рисков: излишняя самоуверенность (overconfidence bias), предвзятость подтверждения (confirmation bias), эскалация обязательств (escalation of commitment). Анализ эффекта «якоря», иллюзии контроля и ошибки доступности при стратегическом планировании. Разработка методов «дебиасинга» (debiasing) для повышения качества решений в условиях неопределенности.	Самостоятельная работа	9	6	ПК-2 ПК-1
1.12	Риск-менеджмент в стратегических альянсах и партнерствах Идентификация специфических рисков стратегических альянсов: оппортунистическое поведение партнера, утечка интеллектуальной собственности, асимметрия информации, культурные и операционные конфликты. Разработка механизмов распределения рисков между	Самостоятельная работа	9	6	ПК-2 ПК-1

	партнерами через договорные конструкции и совместные органы управления. Применение инструментов мониторинга и контроля в альянсах: совместные риск-комитеты, аудиты, KRI на уровне партнерства.				
<b>Раздел 2. Риск-менеджмент в процессе стратегического управления</b>					
№	Наименование темы, краткое содержание	Вид занятия / работы / форма ПА	Семестр / Курс	Количество часов	Компетенции
2.1	Интеграция риск-менеджмента в процессы стратегического планирования Одновременный анализ рисков и возможностей на этапе разработки стратегии, риск-аппетит и риск-емкость организации, установление лимитов на отдельные виды рисков, KPI и KRI (ключевые индикаторы риска), встраивание контрольных точек в цикл планирования, корректировка планов в режиме реального времени, риск-ориентированное бюджетирование, согласование стратегических целей с уровнем принимаемого риска, итеративный пересмотр стратегических гипотез.	Лекционные занятия	9	4	ПК-2 ПК-1
2.2	Управление рисками стратегического проекта: риск-реестр и план реагирования Формирование риск-реестра проекта с фиксацией идентифицированных рисков, их количественной и качественной оценки. Назначение ответственных лиц за каждый риск и разработка плана реагирования на рисковые события. Определение ключевых индикаторов риска (KRI) для мониторинга проекта и процедура регулярного пересмотра профиля риска на проектных комитетах.	Лабораторные занятия	9	4	ПК-2 ПК-1
2.3	Методы и инструменты управления стратегическими рисками Уклонение от риска: отказ от опасных проектов и рынков, снижение риска: диверсификация, резервирование и контроль, передача риска: страхование, аутсорсинг, хеджирование, принятие риска: удержание и создание резервных фондов, диверсификация продуктового портфеля и рынков сбыта, хеджирование валютных и процентных рисков, самострахование и формирование резервов, заключение договоров с распределением ответственности, выбор метода в зависимости от приемлемости риска.	Самостоятельная работа	9	4	ПК-2 ПК-1
2.4	Управление рисками бизнес-процессов и стратегических проектов Риск-реестр стратегического проекта, ответственные лица за риски, план реагирования на рисковые события, Key Risk Indicators (KRI) — ключевые индикаторы риска, мониторинг отклонений параметров бизнес-процессов, контрольные точки и вехи проекта, регулярные проектные комитеты, пересмотр профиля риска, корректирующие воздействия, управление изменениями в проекте, пост-проектный анализ реализовавшихся рисков.	Самостоятельная работа	9	4	ПК-2 ПК-1
2.5	Стратегическая карта рисков и система раннего предупреждения Причинно-следственные связи между источниками и рисковыми событиями, визуализация уязвимых звеньев стратегии, пороговые значения и триггеры, Early Warning System (EWS), мониторинг индикаторов внешней и внутренней среды, автоматическая активация сценариев реагирования, превентивные меры до наступления кризиса, дашборды ключевых индикаторов, регламент срабатывания триггеров, интеграция EWS с процессом принятия стратегических решений.	Самостоятельная работа	9	8	ПК-2 ПК-1
2.6	Организационные аспекты риск-менеджмента на предприятии Риск-культура организации, открытая коммуникация о рисках, «три линии защиты» (подразделения, риск-функция, внутренний аудит), распределение полномочий: совет директоров, топ-менеджмент, подразделения, функции риск-менеджера и департамента риск-менеджмента, риск-комитеты и их роль, разработка методологии и политик, подготовка интегрированной отчетности, обучение персонала основам риск-менеджмента, мотивация и KPI с учетом риск-фактора.	Самостоятельная работа	9	4	ПК-2 ПК-1
2.7	Адаптивное стратегическое управление в условиях неопределенности и кризис-менеджмент Отказ от жестких долгосрочных планов, регулярный пересмотр стратегических гипотез, контингент-планы (contingency plans), автоматическая активация при достижении триггеров, антикризисные стратегии, управляемость в условиях турбулентности, корректировка программ развития в ответ на риски, способность к быстрой перестройке, извлечение уроков из кризисов, устойчивость (resilience) как конкурентное преимущество, обучение на рисковых событиях.	Самостоятельная работа	9	8	ПК-2 ПК-1
2.8	Построение системы раннего предупреждения (Early Warning System) для предприятия Выбор набора ключевых индикаторов риска (KRI) по направлениям: рыночные, финансовые, операционные, репутационные риски. Установление пороговых значений (триггеров) для каждого	Самостоятельная работа	9	10	ПК-2 ПК-1

	индикатора с разделением на зоны внимания, тревоги и кризиса. Разработка сценариев автоматического реагирования при срабатывании триггеров и настройка дашборда для визуализации индикаторов.				
2.9	Организация риск-менеджмента на предприятии: роли, функции и риск-культура Построение модели «трех линий защиты»: операционные подразделения (владение рисками), риск-функция (координация и мониторинг), внутренний аудит (независимая оценка). Распределение полномочий между советом директоров (риск-аппетит), топ-менеджментом (политики и ресурсы) и подразделениями (идентификация и реагирование). Включение риск-факторов в KPI сотрудников и формирование риск-культуры через обучение и открытую коммуникацию.	Самостоятельная работа	9	10	ПК-2 ПК-1
2.10	Адаптивное стратегическое управление и контингент-планирование в условиях неопределенности Разработка контингент-планов (планов на случай непредвиденных обстоятельств) для трех типов кризисных сценариев. Автоматическая активация планов при достижении пороговых значений риска без дополнительных согласований. Регулярный пересмотр стратегических гипотез и корректировка направлений развития по мере поступления новой информации об изменении внешней среды.	Самостоятельная работа	9	8	ПК-2 ПК-1
2.11	Мониторинг и контроль реализации стратегии с использованием KRI и корректирующих воздействий Сопоставление фактических значений KPI и KRI с плановыми и пороговыми значениями в контрольных точках. Анализ отклонений: выявление причин, оценка влияния на стратегические цели и классификация отклонений как допустимых, требующих внимания или критических. Применение корректирующих воздействий: пересмотр планов, запуск контингент-планов, перераспределение ресурсов или изменение стратегических гипотез.	Самостоятельная работа	9	4	ПК-2 ПК-1
2.12	Цифровая трансформация риск-менеджмента: использование больших данных и искусственного интеллекта Анализ возможностей применения технологий больших данных (Big Data) для прогнозирования стратегических рисков и раннего выявления сигналов изменений внешней среды. Использование алгоритмов машинного обучения для классификации и оценки вероятности рисков событий. Внедрение риск-дашбордов с элементами искусственного интеллекта для автоматического мониторинга KRI и предиктивной аналитики.	Самостоятельная работа	9	4	ПК-2 ПК-1
2.13	Разработка бизнес-кейса по внедрению системы стратегического риск-менеджмента на предприятии Формулировка целей, задач и ожидаемых результатов внедрения интегрированной системы риск-менеджмента для конкретной организации (по выбору). Расчет затрат на внедрение (методология, ПО, обучение, штатные единицы) и выгод от снижения стратегических потерь и повышения устойчивости. Подготовка обоснования для совета директоров: обоснование ROI системы риск-менеджмента, дорожная карта внедрения и ключевые показатели эффективности (KPI) для риск-функции.	Самостоятельная работа	9	6	ПК-2 ПК-1
2.14	Подготовка к промежуточной аттестации	Экзамен	9	9	ПК-2 ПК-1

#### 4. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Структура и содержание фонда оценочных средств для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации представлены в Приложении 1 к рабочей программе дисциплины.

#### 5. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

##### 5.1. Учебные, научные и методические издания

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Библиотека / Количество
1	Репина О. М.	Риск-менеджмент: практикум	Йошкар-Ола: Поволжский государственный технологический университет, 2017	ЭБС «Университетская библиотека онлайн»
2	Пасько, Е. А.	Страхование и управление рисками: практикум	Ставрополь: Северо-Кавказский федеральный университет, 2017	ЭБС «IPR SMART»
3		Управление риском: журнал	Москва: Анкил, 2018	ЭБС «Университетская библиотека онлайн»

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Библиотека / Количество
4	Панягина, А. Е., Свистунов, А. В.	Управление рисками на предприятии: теория и практика: учебное пособие	Москва: Ай Пи Ар Медиа, 2020	ЭБС «IPR SMART»

### 5.2. Профессиональные базы данных и информационные справочные системы

Информационная справочная система "КонсультантПлюс"

Информационная справочная система "Гарант"

База статистических данных Федеральной службы государственной статистики <https://rosstat.gov.ru/>

Базы данных Министерства экономического развития Российской Федерации [https://www.economy.gov.ru/material/open\\_data/](https://www.economy.gov.ru/material/open_data/)

ЕМИСС Государственная статистика <https://www.fedstat.ru>

### 5.3. Перечень программного обеспечения

Операционная система РЕД ОС

LibreOffice

### 5.4. Учебно-методические материалы для обучающихся с ограниченными возможностями здоровья

При необходимости по заявлению обучающегося с ограниченными возможностями здоровья учебно-методические материалы предоставляются в формах, адаптированных к ограничениям здоровья и восприятия информации. Для лиц с нарушениями зрения: в форме аудиофайла; в печатной форме увеличенным шрифтом. Для лиц с нарушениями слуха: в форме электронного документа; в печатной форме. Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата: в форме электронного документа; в печатной форме.

## 6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Помещения для всех видов работ, предусмотренных учебным планом, укомплектованы необходимой специализированной учебной мебелью и техническими средствами обучения:

- столы, стулья;
- персональный компьютер / ноутбук (переносной);
- проектор;
- экран / интерактивная доска.

Лабораторные занятия проводятся в компьютерных классах, рабочие места в которых оборудованы необходимыми лицензионными и/или свободно распространяемыми программными средствами и выходом в Интернет, и/или в специализированных лабораториях, предусмотренных образовательной программой.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде.

## 7. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

Методические указания по освоению дисциплины представлены в Приложении 2 к рабочей программе дисциплины.

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ**

**1 Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания**

1.1 Показатели и критерии оценивания компетенций:

ЗУН, составляющие компетенцию	Показатели оценивания	Критерии оценивания	Средства оценивания
ПК-1. Способен разрабатывать стратегии и программы развития организации, осуществлять мониторинг и контроль их реализации.			
<p><b>Знать:</b> теоретические основы и методологию идентификации, оценки и реагирования на риски, возникающие при разработке и реализации стратегий и программ развития организации.</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>– правильно определяет понятия стратегического риска, риск-аппетита, риск-ёмкости;</li> <li>– перечисляет этапы процесса управления рисками;</li> <li>– различает методы качественного и количественного анализа;</li> <li>– воспроизводит классификацию стратегических рисков.</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>– <b>отлично:</b> безошибочно воспроизводит терминологию, классификации и этапы, приводит примеры;</li> <li>– <b>хорошо:</b> допускает 1–2 неточности, но в целом ответ верен;</li> <li>– <b>удовлетворительно:</b> воспроизводит основные понятия с ошибками, требующими наводящих вопросов;</li> <li>– <b>неудовлетворительно:</b> не может назвать базовые термины и этапы.</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>– Вопросы к экзамену (1–20, 31–40);</li> <li>– Тестовые задания (13–18, 19–24, 25–30);</li> <li>– Круглый стол (темы 1–5);</li> <li>– Рефераты (темы 1–8,).</li> </ul>
<p><b>Уметь:</b> разрабатывать стратегии и программы развития с учетом факторов неопределенности, а также осуществлять мониторинг ключевых индикаторов риска для своевременной корректировки планов.</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>– разрабатывает фрагмент стратегии с разделом о рисках;</li> <li>– выбирает KRI и устанавливает пороговые значения;</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>– <b>отлично:</b> самостоятельно и обоснованно выполняет практические задания, аргументирует выбор методов;</li> <li>– <b>хорошо:</b> выполняет задания с незначительными ошибками,</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>– Вопросы к экзамену (41–60);</li> <li>– Ситуационное задание (кейс);</li> <li>– Круглый стол (темы 2, 3, 5);</li> </ul>

	<ul style="list-style-type: none"> <li>– проводит анализ отклонений и формулирует корректирующие воздействия;</li> <li>– применяет PEST, SWOT, сценарное планирование.</li> </ul>	<p>исправляемыми после уточнений;</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>– <b>удовлетворительно</b> : выполняет задания по образцу, испытывает трудности с обоснованием;</li> <li>– <b>неудовлетворительно</b>: не может выполнить практико-ориентированные задания.</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>– Рефераты (темы 11, 12, 15).</li> </ul>
<p><b>Владеть:</b> методами контроля реализации стратегических решений и навыками внесения корректирующих воздействий в программы развития при отклонении фактических показателей риска от запланированных.</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>– анализирует отклонения фактических KPI/KRI от плановых;</li> <li>– предлагает корректирующие мероприятия;</li> <li>– разрабатывает контингент-планы;</li> <li>– оценивает эффективность применённых методов управления рисками.</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>– отлично: демонстрирует навык анализа отклонений и разработки планов реагирования в нестандартных ситуациях;</li> <li>– хорошо: применяет алгоритмы мониторинга и корректировки по шаблону;</li> <li>– удовлетворительно: затрудняется в самостоятельной разработке контингент-планов;</li> <li>– неудовлетворительно: не может предложить корректирующие воздействия.</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>-Ситуационное задание</li> <li>Вопросы к экзамену (48, 49, 58, 59);</li> <li>– Круглый стол (тема 3);</li> <li>– Реферат (темы 16, 17).</li> </ul>
<p>ПК-2. Способен осуществлять стратегическое планирование и управлять предприятиями, бизнес-процессами и проектами с учетом факторов риска в условиях изменяющейся среды.</p>			
<p><b>Знать:</b> методы стратегического планирования и модели управления предприятием, бизнес-процессами и проектами, позволяющие учитывать факторы</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>– перечисляет методы стратегического планирования с учётом рисков;</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>– отлично: свободно ориентируется в методах планирования и инструментах адаптации;</li> <li>– хорошо: воспроизводит основные методы, но</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>– Вопросы к экзамену (21–30, 31–35);</li> <li>– Тестовые задания (1–12);</li> <li>– Круглый стол (темы 1, 4);</li> </ul>

<p>риска и неопределенности в условиях динамично изменяющейся среды.</p>	<p>– объясняет модель «трёх линий защиты»;</p> <p>– различает адаптивное управление и жёсткое планирование;</p> <p>– называет элементы EWS.</p>	<p>не всегда может сравнить их эффективность;</p> <p>– удовлетворительно: знает общие названия методов, но не раскрывает их содержание;</p> <p>– неудовлетворительно: не различает методы планирования и управления рисками.</p>	<p>– Реферат (темы 2, 13, 14).</p>
<p><b>Уметь:</b> осуществлять стратегическое планирование деятельности предприятия, выстраивать бизнес-процессы и управлять проектами, интегрируя процедуры идентификации, оценки и минимизации рисков на всех этапах их жизненного цикла.</p>	<p>– строит тепловую карту рисков;</p> <p>– применяет дерево решений, анализ чувствительности, сценарный анализ;</p> <p>– распределяет роли в риск-менеджменте;</p> <p>– интегрирует риск-аппетит в стратегические KPI.</p>	<p>– отлично: самостоятельно строит модели оценки рисков и обосновывает выбор инструментов;</p> <p>– хорошо: применяет методы по инструкции, но затрудняется в выборе между альтернативами;</p> <p>– удовлетворительно: выполняет простейшие расчёты (чувствительность) по образцу;</p> <p>– неудовлетворительно: не может применить количественные методы оценки.</p>	<p>– Вопросы к экзамену (41–47, 50–57);</p> <p>– Ситуационное задание</p> <p>Круглый стол (тема 2);</p> <p>– Реферат (темы 5–7, 9).</p>
<p><b>Владеть:</b> навыками адаптивного управления предприятием, бизнес-процессами и проектами, обеспечивающими своевременную корректировку стратегических планов при изменении</p>	<p>– разрабатывает контингент-планы и сценарии реагирования;</p> <p>– корректирует стратегию на основе фактических отклонений;</p>	<p>– отлично: демонстрирует готовность к пересмотру стратегии в ответ на изменение рисков, предлагает нетривиальные решения;</p> <p>– хорошо: корректирует планы</p>	<p>– Ситуационное задание</p> <p>– Вопросы к экзамену (56–60);</p> <p>– Круглый стол (тема 4);</p> <p>– Реферат (темы 15–17, 20).</p>

профиля риска внешней и внутренней среды.	– формулирует рекомендации совету директоров по изменению риск-аппетита;  – оценивает резилиентность организации.	по заданным отклонениям, но не инициирует пересмотр гипотез самостоятельно;  – удовлетворительно: воспроизводит стандартные корректировки, не адаптируя их под специфику ситуации;  – неудовлетворительно: не может предложить изменения в стратегии при изменении профиля риска.	
---	---	---	--

## 1.2 Шкалы оценивания:

Текущий контроль успеваемости и промежуточная аттестация осуществляется в рамках накопительной балльно-рейтинговой системы в 100-балльной шкале:

Экзамен

- 84-100 баллов (оценка «отлично»)
- 67-83 баллов (оценка «хорошо»)
- 50-66 баллов (оценка «удовлетворительно»)
- 0-49 баллов (оценка «неудовлетворительно»)

2 Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы

## Вопросы к экзамену

### Часть 1

1. Понятие стратегического риска и его отличие от операционного и финансового рисков.
2. Неопределенность как источник стратегических рисков: внешние и внутренние факторы неопределенности.
3. Место риск-менеджмента в системе стратегического управления предприятием.
4. Принципы интеграции риск-ориентированного подхода в процессы разработки и реализации стратегии.
5. Классификация стратегических рисков: внешние и внутренние, прямые и косвенные, систематические и несистематические.
6. Макроэкономические и геополитические риски: источники возникновения и методы оценки.

7. Отраслевые и конкурентные риски: анализ пяти сил Портера как инструмент идентификации.
8. Внутренние стратегические риски: управленческие, ресурсные, операционные, инновационные.
9. Понятие риск-аппетита (risk appetite) и риск-емкости (risk capacity) организации.
10. Связь между стратегическими целями, ключевыми показателями эффективности (KPI) и ключевыми индикаторами риска (KRI).
11. PEST-анализ как инструмент идентификации внешних стратегических рисков.
12. SWOT-анализ для выявления уязвимостей стратегии и угроз со стороны внешней среды.
13. Сценарное планирование как метод оценки стратегических рисков в условиях высокой неопределенности.
14. Метод «дерева решений» для структурирования стратегических задач и оценки альтернатив.
15. Анализ чувствительности: определение критических факторов, влияющих на достижение стратегических показателей.
16. Имитационное моделирование Монте-Карло для оценки вероятностных распределений результатов стратегии.
17. Стресс-тестирование и расчет Value at Risk (VaR) в стратегическом риск-менеджменте.
18. Качественные методы идентификации рисков: мозговой штурм, метод Дельфи, интервью с экспертами.
19. Построение тепловой карты рисков (heat map) и стратегической карты рисков.
20. Реестр стратегических рисков: структура, содержание и порядок ведения.
21. Уклонение от риска: условия применения, преимущества и ограничения.
22. Снижение риска через диверсификацию продуктового портфеля, рынков сбыта и поставщиков.
23. Резервирование ресурсов и создание систем внутреннего контроля как методы снижения риска.
24. Передача риска: страхование, аутсорсинг, хеджирование и договорное распределение ответственности.
25. Принятие риска: формирование резервных фондов и разработка планов действий.
26. Выбор метода управления риском в зависимости от приемлемости риска и соотношения «затраты — выгода».
27. Интеграция риск-менеджмента в процессы стратегического планирования и бюджетирования.
28. Управление рисками стратегических проектов: риск-реестр, план реагирования, мониторинг KRI.
29. Управление рисками бизнес-процессов: идентификация узких мест и критических точек отказа.
30. Роль диверсификации в снижении портфельных стратегических рисков.
31. Система раннего предупреждения (Early Warning System): компоненты, триггеры и пороговые значения.
32. Ключевые индикаторы риска (KRI): отличие от KPI, выбор и настройка для стратегического контроля.
33. Процедура мониторинга реализации стратегии: контрольные точки, анализ отклонений и корректирующие воздействия.
34. Организация риск-менеджмента на предприятии: модель «трех линий защиты» и распределение полномочий.
35. Функции риск-менеджера и департамента риск-менеджмента в стратегическом управлении.

36. Формирование риск-культуры организации: принципы, инструменты и показатели эффективности.
  37. Адаптивное стратегическое управление: регулярный пересмотр гипотез и корректировка планов.
  38. Контингент-планирование (contingency planning): разработка планов на случай непредвиденных обстоятельств.
  39. Кризис-менеджмент как экстренная форма управления рисками: активация антикризисных стратегий.
  40. Устойчивость (resilience) организации как результат эффективного стратегического риск-менеджмента.
- добавь еще 20 вопросов, которые практикоориентированы. такие которые смогут проверить навыки

## Часть 2

### Практико-ориентированные вопросы

41. Разработка фрагмента стратегии развития организации для компании, выходящей на новый географический рынок, с обязательным включением раздела о ключевых рисках и планах их минимизации.
42. Проведение PEST-анализа для предприятия розничной торговли и составление реестра из пяти стратегических рисков на основе выявленных факторов.
43. Построение тепловой карты рисков для инвестиционного проекта с оценкой вероятности и влияния каждого риска по шкале «низкий — средний — высокий».
44. Расчет риск-аппетита организации на основе соотношения целевой доходности и допустимого уровня потерь (при заданных финансовых показателях).
45. Выбор метода управления для каждого из пяти стратегических рисков (уклонение, снижение, передача, принятие) с письменным обоснованием выбора.
46. Разработка риск-реестра для стратегического проекта (например, запуск новой продуктовой линии) с заполнением колонок: риск, оценка, ответственный, план реагирования.
47. Определение трех ключевых индикаторов риска (KRI) для мониторинга финансовой устойчивости предприятия и установление пороговых значений (триггеров) для каждого.
48. Анализ отклонений фактических KPI от плановых на основе смоделированной отчетности и формулировка корректирующих воздействий.
49. Разработка контингент-плана (плана на случай непредвиденных обстоятельств) для сценария «резкое падение спроса на 30% за один месяц».
50. Применение метода «дерева решений» для выбора между двумя стратегическими альтернативами с учетом вероятностей рисковых событий и ожидаемой доходности.
51. Проведение анализа чувствительности для инвестиционного проекта: определение критического изменения цены сырья, при котором NPV становится нулевым.
52. Формулировка сценария реагирования для системы раннего предупреждения (EWS) при срабатывании триггера «рост просроченной дебиторской задолженности выше 15%».
53. Распределение ролей и ответственности по модели «три линии защиты» для конкретного предприятия (по выбору) с описанием функций каждой линии.
54. Разработка предложений по формированию риск-культуры в организации, включая обучение, коммуникации и включение риск-факторов в KPI сотрудников.
55. Оценка эффективности примененного метода управления риском (например, страхования или диверсификации) на основе данных о фактических потерях и затратах.
56. Построение сценариев (оптимистичный, базовый, пессимистичный) для стратегии развития и расчет разброса ключевого показателя эффективности.
57. Применение метода Монте-Карло (концептуально) для оценки вероятности достижения целевого показателя ROI при заданных распределениях факторов риска.

58. Разработка процедуры мониторинга стратегических рисков для предприятия с указанием периодичности, ответственных, форматов отчетности и точек принятия решений.

59. Анализ бизнес-кейса на предмет ошибок в управлении рисками (например, недооценка конкурентных угроз или отсутствие контингент-плана) и формулировка рекомендаций.

60. Разработка дорожной карты внедрения системы стратегического риск-менеджмента на предприятии с указанием этапов, сроков, ресурсов и ключевых результатов каждого этапа.

Экзаменационный билет содержит два вопроса из приведенных выше: один из первой часть один из второй.

#### Критерии оценки

- 84-100 баллов (оценка «отлично») - изложенный материал фактически верен, наличие глубоких исчерпывающих знаний в объеме пройденной программы дисциплины в соответствии с поставленными программой курса целями и задачами обучения; правильные, уверенные действия по применению полученных знаний на практике, грамотное и логически стройное изложение материала при ответе, усвоение основной и знакомство с дополнительной литературой;

- 67-83 баллов (оценка «хорошо») - наличие твердых и достаточно полных знаний в объеме пройденной программы дисциплины в соответствии с целями обучения, правильные действия по применению знаний на практике, четкое изложение материала, допускаются отдельные логические и стилистические погрешности, обучающийся усвоил основную литературу, рекомендованную в рабочей программе дисциплины;

- 50-66 баллов (оценка «удовлетворительно») - наличие твердых знаний в объеме пройденного курса в соответствии с целями обучения, изложение ответов с отдельными ошибками, уверенно исправленными после дополнительных вопросов; правильные в целом действия по применению знаний на практике;

- 0-49 баллов (оценка «неудовлетворительно») - ответы не связаны с вопросами, наличие грубых ошибок в ответе, непонимание сущности излагаемого вопроса, неумение применять знания на практике, неуверенность и неточность ответов на дополнительные и наводящие вопросы.

#### Тестовые задания

#### Тесты для ПК-1.

##### Задание 1

**Тип задания:** Задание закрытого типа на установление соответствия.

**Текст задания:**

Прочитайте текст и установите соответствие.

При разработке стратегии развития организации необходимо соотносить этапы стратегического риск-менеджмента с их содержательным наполнением. К каждой позиции, данной в левом столбце, подберите соответствующую позицию из правого столбца:

А	Идентификация стратегических рисков	1	Установление лимитов на отдельные виды рисков и определение риск-аппетита
Б	Оценка стратегических рисков	2	Применение PEST-анализа, SWOT-анализа и сценарного планирования для выявления угроз
В	Выбор методов управления рисками	3	Расчет VaR, стресс-тестирование и имитационное моделирование Монте-Карло
Г	Установление риск-аппетита	4	Уклонение, снижение, передача или принятие риска в зависимости от его приемлемости
		5	Пост-проектный анализ реализовавшихся рисков и извлечение уроков

**Запишите выбранные цифры под соответствующими буквами, каждый элемент правого столбца используется один раз:**

А	Б	В	Г

## Задание 2

**Тип задания:** Задание закрытого типа на установление соответствия.

**Текст задания:**

Прочитайте текст и установите соответствие.

Система раннего предупреждения (Early Warning System) в стратегическом управлении включает несколько ключевых компонентов, которые необходимо соотнести с их характеристиками. К каждой позиции, данной в левом столбце, подберите соответствующую позицию из правого столбца:

А	Ключевые индикаторы риска (KRI)	1	Значения, при достижении которых автоматически запускается сценарий реагирования
Б	Пороговые значения (триггеры)	2	Визуализация связей между источниками риска и стратегическими целями
В	Стратегическая карта рисков	3	Показатели, отслеживающие динамику факторов риска в оперативном режиме
Г	Сценарии реагирования	4	Заранее разработанные планы действий при срабатывании триггеров

		5	Процедура расчета максимально возможных потерь при неблагоприятном сценарии
--	--	---	---

**Запишите выбранные цифры под соответствующими буквами, каждый элемент правого столбца используется один раз:**

А	Б	В	Г

### Задание 3

**Тип задания:** Задание закрытого типа на установление соответствия.

**Текст задания:**

Прочитайте текст и установите соответствие.

В процессе мониторинга и контроля реализации стратегических программ развития используются различные инструменты, которые необходимо соотнести с их целевым назначением. К каждой позиции, данной в левом столбце, подберите соответствующую позицию из правого столбца:

А	Анализ отклонений	1	Регулярные заседания для пересмотра профиля риска и корректирующих воздействий
Б	Контрольные точки (вехи)	2	Сопоставление фактических KPI и KRI с плановыми значениями
В	Проектные комитеты	3	Документ, фиксирующий идентифицированные риски и ответственных лиц
Г	Риск-реестр	4	Заранее установленные этапы реализации стратегии для промежуточного контроля
		5	Метод передачи риска через аутсорсинг неключевых функций

**Запишите выбранные цифры под соответствующими буквами, каждый элемент правого столбца используется один раз:**

А	Б	В	Г

### Задание 4

**Тип задания:** Задание закрытого типа на установление последовательности.

**Текст задания:**

Прочитайте текст и установите последовательность.

Процесс интеграции риск-менеджмента в стратегическое планирование предполагает последовательное выполнение следующих этапов:

1. Корректировка стратегических планов в режиме реального времени
2. Идентификация рисков одновременно с анализом возможностей
3. Мониторинг ключевых индикаторов риска (KRI)
4. Установление риск-аппетита и лимитов на отдельные виды рисков
5. Оценка вероятности и влияния идентифицированных рисков
6. Выбор методов управления рисками

**Запишите соответствующую последовательность цифр слева направо:**

--	--	--	--	--	--

### Задание 5

*Тип задания:* Задание закрытого типа на установление последовательности.

*Текст задания:*

Прочитайте текст и установите последовательность.

При построении системы раннего предупреждения (Early Warning System) в организации необходимо соблюдать следующую логическую последовательность действий:

1. Разработка сценариев реагирования на каждый триггер
2. Определение пороговых значений (триггеров) для каждого индикатора
3. Выбор ключевых индикаторов риска (KRI) для мониторинга
4. Автоматическая активация сценария при достижении триггера
5. Интеграция EWS с процессом принятия стратегических решений
6. Настройка дашбордов для визуализации индикаторов

**Запишите соответствующую последовательность цифр слева направо:**

--	--	--	--	--	--

### Задание 6

*Тип задания:* Задание закрытого типа на установление последовательности.

*Текст задания:*

Прочитайте текст и установите последовательность.

Управление рисками стратегического проекта в рамках контроля его реализации включает следующие этапы в хронологическом порядке:

1. Разработка плана реагирования на рисковые события
2. Пост-проектный анализ реализовавшихся рисков
3. Регулярный пересмотр профиля риска на проектных комитетах
4. Формирование риск-реестра на этапе инициации проекта
5. Мониторинг ключевых индикаторов риска (KRI) в ходе выполнения
6. Применение корректирующих воздействий при отклонениях

**Запишите соответствующую последовательность цифр слева направо:**

--	--	--	--	--	--

### **Задание 7**

**Тип задания:** Задание закрытого типа с выбором нескольких верных ответов из предложенных.

**Текст задания:**

Прочитайте текст, выберите все правильные варианты ответа.

К методам снижения стратегических рисков при разработке программ развития организации относятся:

1. Полный отказ от стратегически опасных проектов
2. Диверсификация продуктового портфеля и рынков сбыта
3. Передача риска через страхование
4. Резервирование ресурсов на случай реализации риска
5. Заключение договоров с полным распределением ответственности на контрагента
6. Внедрение систем внутреннего контроля и повышение качества стратегического анализа

**Варианты ответа.**

### **Задание 8**

**Тип задания:** Задание закрытого типа с выбором нескольких верных ответов из предложенных.

**Текст задания:**

Прочитайте текст, выберите все правильные варианты ответа.

К ключевым элементам формирования риск-культуры организации, обеспечивающим эффективный мониторинг и контроль реализации стратегий, относятся:

1. Скрытие информации о потенциальных угрозах от руководства для избежания санкций
2. Открытая коммуникация о рисках между сотрудниками всех уровней
3. Восприятие процедур риск-менеджмента как бюрократической нагрузки
4. Обучение персонала основам риск-ориентированного управления
5. Включение риск-факторов в систему мотивации и KPI сотрудников
6. Централизация всех решений по рискам исключительно на уровне риск-менеджера

**Варианты ответа.**

### **Задание 9**

**Тип задания:** Задание закрытого типа с выбором нескольких верных ответов из предложенных.

**Текст задания:**

Прочитайте текст, выберите все правильные варианты ответа.

При осуществлении контроля реализации стратегических программ развития организация использует следующие инструменты мониторинга рисков:

1. Сопоставление фактических KPI и KRI с плановыми значениями
2. Разработка контингент-планов на случай непредвиденных обстоятельств
3. Регулярные заседания проектных и стратегических комитетов
4. Единовременная оценка рисков только на этапе утверждения стратегии
5. Отслеживание динамики факторов риска через дашборды индикаторов

6. Пересмотр профиля риска и корректирующие воздействия по результатам мониторинга

**Варианты ответа.**

### Задание 10

*Тип задания:* Задание закрытого типа с выбором одного верного ответа из предложенных.

*Текст задания:*

Прочитайте текст и выберите правильный ответ.

Процесс определения количественно выраженного уровня риска, который организация готова принять ради достижения желаемой доходности, называется:

1. Риск-емкость организации
2. Риск-аппетит
3. Риск-бюджет
4. Риск-лимит
5. Риск-профиль

**Вариант ответа.**

### Задание 11

*Тип задания:* Задание закрытого типа с выбором одного верного ответа из предложенных.

*Текст задания:*

Прочитайте текст и выберите правильный ответ.

Метод количественной оценки стратегических рисков, основанный на генерации тысяч возможных сценариев для построения вероятностного распределения конечных результатов, называется:

1. Анализ чувствительности
2. Стресс-тестирование
3. Имитационное моделирование Монте-Карло
4. Расчет Value at Risk (VaR)
5. Детерминированный анализ

**Вариант ответа.**

### Задание 12

*Тип задания:* Задание закрытого типа с выбором одного верного ответа из предложенных.

*Текст задания:*

Прочитайте текст и выберите правильный ответ.

В модели организации риск-менеджмента «три линии защиты» функция непосредственного управления стратегическими рисками и их мониторинга на уровне бизнес-процессов относится к:

1. Совету директоров
2. Первой линии защиты (операционные подразделения)
3. Второй линии защиты (департамент риск-менеджмента)
4. Третьей линии защиты (внутренний аудит)
5. Внешним консультантам

**Вариант ответа.**

### **Задание 13**

*Тип задания:* Задание открытого типа с развернутым ответом.

*Текст задания:*

Прочитайте текст и запишите ответ.

Документ, в котором фиксируются идентифицированные риски стратегического проекта, их количественная и качественная оценка, ответственные лица и запланированные мероприятия по реагированию, называется \_\_\_\_\_.

**Укажите правильный ответ:**

### **Задание 14**

*Тип задания:* Задание открытого типа с развернутым ответом.

*Текст задания:*

Прочитайте текст и запишите ответ.

Метод управления стратегическим риском, предполагающий сознательное удержание риска организацией без его передачи третьим лицам, но с созданием резервных фондов и планов действий, называется \_\_\_\_\_ риска.

**Укажите правильный ответ:**

### **Задание 15**

*Тип задания:* Задание открытого типа с развернутым ответом.

*Текст задания:*

Прочитайте текст и запишите ответ.

Способность организации быстро перестраивать стратегические планы и бизнес-процессы в ответ на реализовавшиеся рискованные события, извлекая уроки из кризисов, называется \_\_\_\_\_.

**Укажите правильный ответ:**

## Тесты для ПК-2.

### Задание 16

**Тип задания:** Задание закрытого типа на установление соответствия.

**Текст задания:**

Прочитайте текст и установите соответствие.

При стратегическом планировании с учетом факторов риска необходимо соотносить методы управления рисками с конкретными инструментами их реализации. К каждой позиции, данной в левом столбце, подберите соответствующую позицию из правого столбца:

А	Уклонение от риска	1	Формирование резервных фондов и создание планов действий
Б	Снижение риска	2	Отказ от выхода на новый географический рынок с высоким уровнем нестабильности
В	Передача риска	3	Диверсификация поставщиков и внедрение системы внутреннего контроля
Г	Принятие риска	4	Заключение договора страхования ответственности и хеджирование валютных рисков
		5	Проведение стресс-тестирования и имитационного моделирования

**Запишите выбранные цифры под соответствующими буквами, каждый элемент правого столбца используется один раз:**

А	Б	В	Г

### Задание 17

**Тип задания:** Задание закрытого типа на установление соответствия.

**Текст задания:**

Прочитайте текст и установите соответствие.

В процессе адаптивного стратегического управления предприятием в условиях изменяющейся среды используются различные подходы, которые необходимо соотнести с их характеристиками. К каждой позиции, данной в левом столбце, подберите соответствующую позицию из правого столбца:

А	Сценарное планирование	1	Разработка заранее подготовленных планов действий на случай кризиса
Б	Контингент-планирование	2	Регулярный пересмотр стратегических гипотез при изменении внешних условий
В	Адаптивное управление	3	Разработка нескольких альтернативных вариантов будущего для оценки устойчивости стратегии

Г	Кризис-менеджмент	4	Автоматическая активация антикризисных мер при достижении пороговых значений риска
		5	Полный отказ от долгосрочного планирования в пользу оперативных решений

Запишите выбранные цифры под соответствующими буквами, каждый элемент правого столбца используется один раз:

А	Б	В	Г

### Задание 18

*Тип задания:* Задание закрытого типа на установление соответствия.

*Текст задания:*

Прочитайте текст и установите соответствие.

Управление бизнес-процессами предприятия с учетом факторов риска требует соотнесения типов рисков с примерами их проявления. К каждой позиции, данной в левом столбце, подберите соответствующую позицию из правого столбца:

А	Операционный риск	1	Изменение курса валют и процентных ставок по кредитам
Б	Финансовый риск	2	Появление нового конкурента с прорывной технологией
В	Рыночный риск	3	Сбой в работе логистической системы из-за отказа поставщика
Г	Репутационный риск	4	Снижение лояльности клиентов после публикации негативных отзывов
		5	Принятие нового закона, ограничивающего деятельность предприятия

Запишите выбранные цифры под соответствующими буквами, каждый элемент правого столбца используется один раз:

А	Б	В	Г

### Задание 19

*Тип задания:* Задание закрытого типа на установление последовательности.

*Текст задания:*

Прочитайте текст и установите последовательность.

Процесс управления стратегическим проектом с учетом факторов риска в условиях изменяющейся среды включает следующие шаги в логической последовательности:

1. Применение корректирующих воздействий при отклонении KRI от пороговых значений

2. Разработка риск-реестра и плана реагирования на рисковые события
3. Мониторинг ключевых индикаторов риска (KRI) на всех этапах проекта
4. Идентификация факторов риска на этапе инициации проекта
5. Регулярный пересмотр профиля риска на заседаниях проектного комитета
6. Оценка вероятности и потенциального влияния каждого риска

**Запишите соответствующую последовательность цифр слева направо:**

--	--	--	--	--	--

### **Задание 20**

**Тип задания:** *Задание закрытого типа на установление последовательности.*

**Текст задания:**

Прочитайте текст и установите последовательность.

При внедрении системы управления бизнес-процессами с учетом факторов риска рекомендуется соблюдать следующую последовательность действий:

1. Настройка дашбордов для визуализации ключевых индикаторов риска (KRI)
2. Определение пороговых значений (триггеров) для каждого индикатора
3. Выбор критических бизнес-процессов для мониторинга рисков
4. Автоматическое оповещение ответственных лиц при срабатывании триггера
5. Идентификация факторов риска для каждого выбранного бизнес-процесса
6. Разработка сценариев реагирования на превышение пороговых значений

**Запишите соответствующую последовательность цифр слева направо:**

--	--	--	--	--	--

### **Задание 21**

**Тип задания:** *Задание закрытого типа на установление последовательности.*

**Текст задания:**

Прочитайте текст и установите последовательность.

Организация адаптивного стратегического управления предприятием в условиях изменяющейся среды требует выполнения следующих этапов:

1. Корректировка стратегических планов и программ развития
2. Мониторинг изменений внешней и внутренней среды
3. Оценка влияния изменений на достижение стратегических целей
4. Выявление отклонений фактических показателей от плановых значений
5. Принятие решения о необходимости пересмотра стратегических гипотез
6. Запуск контингент-планов при достижении пороговых значений риска

**Запишите соответствующую последовательность цифр слева направо:**

--	--	--	--	--	--

### **Задание 22**

**Тип задания:** *Задание закрытого типа с выбором нескольких верных ответов из предложенных.*

**Текст задания:**

Прочитайте текст, выберите все правильные варианты ответа.

К методам передачи стратегических рисков при управлении предприятием и проектами относятся:

1. Страхование ответственности перед третьими лицами
2. Формирование резервного фонда на случай непредвиденных расходов
3. Аутсорсинг неключевых бизнес-процессов
4. Хеджирование валютных и процентных рисков на срочном рынке
5. Диверсификация продуктового портфеля
6. Заключение договоров с распределением ответственности между партнерами

**Варианты ответа.**

### **Задание 23**

*Тип задания:* Задание закрытого типа с выбором нескольких верных ответов из предложенных.

*Текст задания:*

Прочитайте текст, выберите все правильные варианты ответа.

В условиях высокой неопределенности внешней среды при стратегическом планировании предприятия целесообразно использовать следующие инструменты адаптивного управления:

1. Жесткие долгосрочные планы с фиксированными показателями на 5 лет
2. Сценарное планирование с разработкой альтернативных вариантов будущего
3. Единовременную оценку рисков только на старте стратегического планирования
4. Регулярный пересмотр стратегических гипотез по мере поступления новой информации
5. Контингент-планы (планы на случай непредвиденных обстоятельств)
6. Централизацию всех стратегических решений без учета обратной связи от подразделений

**Варианты ответа.**

### **Задание 24**

*Тип задания:* Задание закрытого типа с выбором нескольких верных ответов из предложенных.

*Текст задания:*

Прочитайте текст, выберите все правильные варианты ответа.

При мониторинге рисков бизнес-процессов предприятия в рамках стратегического контроля используются следующие ключевые индикаторы риска (KRI):

1. Частота сбоев в работе критического оборудования
2. Уровень просроченной дебиторской задолженности
3. Количество сотрудников, прошедших обучение по риск-менеджменту
4. Коэффициент текучести кадров в ключевых подразделениях
5. Отклонение фактических сроков выполнения проекта от плановых
6. Доля рынка, занимаемая предприятием

**Варианты ответа.**

### Задание 25

**Тип задания:** Задание закрытого типа с выбором одного верного ответа из предложенных.

**Текст задания:**

Прочитайте текст и выберите правильный ответ.

Процесс регулярного пересмотра стратегических гипотез и корректировки направлений развития предприятия по мере поступления новой информации об изменении внешней среды называется:

1. Стратегическое планирование
2. Адаптивное стратегическое управление
3. Бюджетирование
4. Операционный контроллинг
5. Формальное прогнозирование

**Вариант ответа.**

### Задание 26

**Тип задания:** Задание закрытого типа с выбором одного верного ответа из предложенных.

**Текст задания:**

Прочитайте текст и выберите правильный ответ.

Заранее разработанный план действий, который автоматически активируется при достижении пороговых значений стратегических рисков, называется:

1. Стратегическая карта рисков
2. Бизнес-план
3. Контингент-план (план на случай непредвиденных обстоятельств)
4. Операционный график
5. Финансовый план

**Вариант ответа.**

### Задание 27

**Тип задания:** Задание закрытого типа с выбором одного верного ответа из предложенных.

**Текст задания:**

Прочитайте текст и выберите правильный ответ.

Показатель, позволяющий отслеживать динамику факторов риска в оперативном режиме и фиксировать отклонения параметров бизнес-процессов от целевых значений, обозначается аббревиатурой:

1. KPI
2. KRI

- 3. ROI
- 4. EVA
- 5. EBITDA

**Вариант ответа.**

**Задание 28**

*Тип задания:* Задание открытого типа с развернутым ответом.

*Текст задания:*

Прочитайте текст и запишите ответ.

Способность организации сохранять управляемость и достигать стратегических целей в условиях реализации рисковых событий, обеспечиваемая за счет заранее разработанных контингент-планов, называется \_\_\_\_\_.

**Укажите правильный ответ:**

**Задание 29**

*Тип задания:* Задание открытого типа с развернутым ответом.

*Текст задания:*

Прочитайте текст и запишите ответ.

Финансовый инструмент управления рисками, позволяющий зафиксировать будущую цену актива для защиты от неблагоприятных колебаний рыночных цен, называется \_\_\_\_\_.

**Укажите правильный ответ:**

**Задание 30**

*Тип задания:* Задание открытого типа с развернутым ответом.

*Текст задания:*

Прочитайте текст и запишите ответ.

Процесс передачи части функций или бизнес-процессов внешнему исполнителю с целью снижения операционных и управленческих рисков предприятия называется \_\_\_\_\_.

**Укажите правильный ответ:**

За каждый правильный ответ выставляется 1 балл. Максимум за тесты 30 баллов за семестр.

**Перечень дискуссионных тем для круглого стола**

**Тема 1. Сравнительный анализ национальных и международных стандартов риск-менеджмента (COSO ERM, ISO 31000, ГОСТ Р ИСО 31000)**

1) Российский ГОСТ Р ИСО 31000 формально гармонизирован с международной версией, но на практике требования к документированию в России ведут к бюрократизации процесса, а не к интеграции рисков в стратегию.

2) COSO ERM, в отличие от ISO 31000, делает риски не просто процессом, а частью стратегического управления и корпоративной культуры, однако именно этот аспект оказывается самым труднореализуемым в компаниях с жёсткой иерархией.

3) Различия в терминологии между COSO ERM и ISO 31000 («аппетит к риску» vs «критерии риска», «события» vs «источники риска») создают реальные сложности при попытке построить единую систему риск-менеджмента в международных группах компаний.

## **Тема 2. Поведенческие аспекты стратегического риск-менеджмента: когнитивные искажения при принятии решений**

1) Излишняя самоуверенность (overconfidence bias) топ-менеджеров является более значимой причиной стратегических провалов, чем недостаток данных или аналитики.

2) Эскалация обязательств в стратегических проектах не может быть преодолена методами дебиасинга, пока сохраняется привязка бонусов менеджеров к продолжению, а не к сворачиванию проектов.

3) Эффект «якоря» и ошибка доступности в стратегическом планировании неустранимы полностью, но можно внедрить обязательную процедуру «красной команды» (devil's advocate) как корпоративный стандарт.

## **Тема 3. Риск-менеджмент в стратегических альянсах и партнёрствах**

1) Любая договорная конструкция в альянсе неспособна полностью предотвратить оппортунистическое поведение партнёра, если отсутствует взаимная экономическая зависимость.

2) Распределение рисков через совместные органы управления часто оказывается фикцией, так как реальное право вето остаётся у более сильного партнёра.

3) Мониторинг KRI на уровне партнёрства создаёт ложное чувство контроля, если не сопровождается регулярными совместными аудитами с правом доступа к первичным данным обеих сторон.

## **Тема 4. Цифровая трансформация риск-менеджмента: использование больших данных и искусственного интеллекта**

1) Технологии Big Data позволяют выявлять сигналы стратегических рисков раньше человека, но порождают проблему «ложных тревог», снижающую доверие к системе.

2) Алгоритмы машинного обучения при оценке вероятности рисков не могут заменить эксперта в ситуациях, когда релевантные исторические данные отсутствуют (чёрные лебеди).

3) Внедрение риск-дашбордов с искусственным интеллектом без изменения культуры принятия решений ведёт лишь к декоративной автоматизации, а не к повышению качества стратегического риск-менеджмента.

### **Тема 5. Разработка бизнес-кейса по внедрению системы стратегического риск-менеджмента на предприятии**

1) ROI системы риск-менеджмента невозможно рассчитать с точностью, приемлемой для совета директоров, потому что выгода проявляется только в негативных сценариях, которые не наступили.

2) Наиболее весомым аргументом для совета директоров является не снижение стратегических потерь, а выполнение требований регуляторов и страховщиков.

3) Ключевые показатели эффективности риск-функции не должны включать «количество выявленных рисков» — вместо этого необходимы KPI, привязанные к сохранению стратегических инициатив в рамках аппетита к риску.

#### **Критерии оценивания**

Проводится два круглых стола в семестр. Критерии оценивания за участие в одном круглом столе - 10 баллов максимум, за семестр за участие в круглых столах 20 баллов.

- 8-10 баллов выставляется студенту за участие в одном круглом столе, если он правильно и аргументированно обосновал решение;
- 5-7 баллов, если решение в целом правильное, но недостаточно аргументов с позиции менеджмента;
- 3-4 балла за в целом близкое к правильному решению, но обоснования больше интуитивного порядка;
- 0-2 балла при неправильном, не обоснованном решении.

#### **Темы рефератов**

1. Эволюция теории стратегического риск-менеджмента: от страхового подхода к интегрированной модели управления рисками.

2. Сравнительный анализ международных стандартов риск-менеджмента: COSO ERM и ISO 31000.

3. Риск-аппетит и риск-емкость организации: методы определения и роль в стратегическом планировании.

4. PEST-анализ как инструмент идентификации внешних стратегических рисков: практика применения для российских предприятий.

5. Сценарное планирование в условиях высокой неопределенности: методы разработки и оценки сценариев.

6. Имитационное моделирование Монте-Карло для оценки стратегических рисков: возможности и ограничения.

7. Анализ чувствительности и стресс-тестирование как инструменты количественной оценки стратегических рисков.

8. Диверсификация как метод снижения стратегических рисков: продуктовые, рыночные и географические аспекты.

9. Хеджирование финансовых рисков как инструмент стратегического риск-менеджмента: инструменты и практика применения.

10. Аутсорсинг как метод передачи стратегических рисков: преимущества, риски и границы применимости.

11. Система раннего предупреждения (Early Warning System) в стратегическом управлении: построение, индикаторы, триггеры.

12. Ключевые индикаторы риска (KRI) и их интеграция с ключевыми показателями эффективности (KPI) в системе стратегического контроля.

13. Модель «трех линий защиты» в организации стратегического риск-менеджмента: роли, функции и взаимодействие.

14. Формирование риск-культуры организации как фактор успешной реализации стратегии.

15. Адаптивное стратегическое управление: методы и инструменты корректировки стратегии в ответ на изменения среды.

16. Контингент-планирование (contingency planning): разработка планов на случай непредвиденных обстоятельств.

17. Управление рисками стратегических проектов: от риск-реестра до пост-проектного анализа.

18. Поведенческие аспекты стратегического риск-менеджмента: когнитивные искажения и методы их преодоления.

19. Управление рисками в стратегических альянсах и партнерствах: механизмы распределения и контроля рисков.

20. Цифровая трансформация риск-менеджмента: применение больших данных и искусственного интеллекта для прогнозирования стратегических рисков.

### **Критерии оценивания:**

Максимальная оценка за реферат 10 баллов. Выполняется один реферат в семестр. Максимум за реферат 10 баллов за семестр.

- 8-10 баллов выставляется студенту, если он подготовил содержательный реферат с высоким уровнем оригинальности материала;

- 5-7 баллов выставляется студенту, если он подготовил содержательный реферат, но часть материалов скопирована;

- 3-4 баллов при существенной части скопированных материалов и наличии достаточно содержательного материала.

- 0-2 баллов при скопированных материалах и низком уровне включенного в реферат материала.

### **Ситуационное задание**

**Кейс: «Стратегический выход на рынок страны N для компании „ТехноЭкспорт“»**

#### **Ситуационная справка**

Компания «ТехноЭкспорт» — российский производитель промышленного оборудования для пищевой промышленности. Выручка за прошлый год — 8 млрд рублей. Доля на российском рынке — 25%. Рынок насыщен, рост замедляется до 2-3% в год.

Совет директоров утвердил стратегию развития на 2025-2028 годы, включающую выход на рынок страны N (условное государство с развивающейся экономикой). Потенциальная емкость рынка в стране N оценивается в 12 млрд рублей при текущем

импорте оборудования. Цель: за три года занять 15% рынка страны N, увеличив общую выручку компании на 40%.

Стратегия предполагает:

- Открытие представительства в столице страны N
- Найм 50 местных сотрудников (продажи, сервис, логистика)
- Инвестиции в сертификацию оборудования (6-8 месяцев, 50 млн рублей)
- Создание складского хаба (аренда, 100 млн рублей)
- Маркетинговый бюджет (80 млн рублей в первый год)

Подготовлен бизнес-план: NPV проекта — 450 млн рублей, ROI — 22%, срок окупаемости — 4,5 года.

### Исходные данные о рисках (результаты предварительной идентификации)

#### Макросреда страны N:

- В стране N ожидаются парламентские выборы через 10 месяцев
- Национальная валюта страны N за последний год обесценилась на 18% по отношению к рублю
- Таможенное законодательство меняется 2-3 раза в год
- Местные конкуренты (2 крупных завода) имеют ценовое преимущество на 15-20% за счет отсутствия импортных пошлин

#### Внутренние факторы компании:

- Отсутствие опыта работы на рынках данного макрорегиона
- Ключевой сервисный инженер увольняется (знает специфику оборудования для страны N)
- Финансовый резерв компании ограничен (свободные средства — 300 млн рублей)

#### Задания по кейсу

##### Задание 1.

Проведите идентификацию стратегических рисков выхода на рынок страны N. Заполните таблицу, классифицируя риски по группам (внешние/внутренние, систематические/несистематические).

№	Наименование риска	Группа (внешний/внутренний)	Краткое описание источника риска
1	Валютный риск	Внешний	Обесценивание валюты страны N снижает рублевую выручку
2	...	...	...
3	...	...	...
4	...	...	...
5	...	...	...

**Инструкция:** Укажите не менее 5 рисков.

##### Задание 2. Качественная оценка рисков и построение тепловой карты

Оцените каждый из идентифицированных рисков по двум параметрам:

1. Вероятность (низкая — 0-30%, средняя — 30-70%, высокая — 70-100%)
2. Влияние на стратегическую цель (низкое, среднее, высокое)

Постройте тепловую карту рисков (матрицу 3×3). Укажите, какие риски попадают в красную (критическую), желтую (внимание) и зеленую (приемлемую) зоны.

Вероятность / Влияние	Низкое	Среднее	Высокое
Высокая (70-100%)			
Средняя (30-70%)			
Низкая (0-30%)			

**Инструкция:** В каждую ячейку впишите номера рисков из задания 1.

##### Задание 3. Выбор методов управления рисками

Для каждого риска из задания 1 выберите метод управления (уклонение, снижение, передача, принятие) и опишите конкретный инструмент реализации.

№ риска	Метод управления	Инструмент реализации (конкретное действие)
1	Передача	Хеджирование валютного риска через заключение форвардных контрактов
2	...	...
3	...	...
4	...	...
5	...	...

#### Задание 4. Определение ключевых индикаторов риска (KRI) и триггеров

Разработайте систему раннего предупреждения (EWS) для мониторинга стратегических рисков проекта. Для каждого из трех наиболее критических рисков укажите:

Критический риск	KRI (индикатор)	Триггер (пороговое значение)	Действие при срабатывании триггера
1. ...	...	...	...
2. ...	...	...	...
3. ...	...	...	...

#### Задание 5. Адаптивное управление: разработка контингент-плана

Разработайте контингент-план (план на случай непредвиденных обстоятельств) для сценария: «Через 8 месяцев после выхода на рынок страны N местный конкурент снижает цены на 25%, а курс национальной валюты падает еще на 15%».

Заполните план:

Элемент плана	Содержание
Триггер активации	...
Ответственный за активацию	...
Операционные действия (3-5 шагов)	...
Необходимые ресурсы	...
Критерии деактивации плана	...

#### Задание 6. Мониторинг и корректировка стратегии

Через 12 месяцев реализации стратегии получены следующие фактические данные:

Показатель	План	Факт	Отклонение
Доля рынка в стране N	5%	2%	-3%
Выручка в стране N (млн руб.)	240	180	-60
Срок сертификации	6 мес.	9 мес.	+3 мес.
Затраты на маркетинг (млн руб.)	80	110	+30
Текучесть местных сотрудников	10%	25%	+15%

#### Вопросы для анализа:

1. Какие отклонения являются критическими для достижения стратегической цели (15% рынка за три года)?
2. Какие корректирующие воздействия вы предложите руководству?
3. Требуется ли полный пересмотр стратегии или достаточно точечных корректировок?

#### Задание 7. Рекомендации совету директоров

Подготовьте структурированные рекомендации для совета директоров компании «ТехноЭкспорт» по дальнейшей реализации стратегии выхода на рынок страны N. Включите:

- Оценку текущей риск-ситуации
- Предлагаемые изменения в стратегии и программе развития
- Обновленный риск-аппетит организации по данному проекту

- Запрошенные ресурсы и ожидаемый пересмотренный ROI

### Эталонные ответы для преподавателя (краткие ключи)

#### Задание 1 (примеры рисков):

1. Валютный риск (внешний, систематический)
2. Политический риск (изменение законодательства, выборы)
3. Конкурентный риск (ценовое давление локальных игроков)
4. Регуляторный риск (задержка сертификации)
5. Кадровый риск (текучесть местных сотрудников, уход ключевого инженера)
6. Репутационный риск (отсутствие бренда на новом рынке)
7. Операционный риск (сбой в логистике и складском хабе)

#### Задание 3 (примеры методов):

- Валютный риск — передача (хеджирование)
- Конкурентный риск — снижение (дифференциация продукта, сервисное преимущество)
- Регуляторный риск — снижение (найм местного юриста, параллельная сертификация)
- Кадровый риск — снижение (бонусы за удержание, обучение, ротация)
- Политический риск — принятие (мониторинг, контингент-план)

#### Задание 6 (критические отклонения):

- Доля рынка (отставание на 3% при плане 5%) — критическое отклонение
- Текучесть персонала (25% против 10%) — критическое, влияет на операционную способность
- Сертификация (+3 месяца) — критическое, блокирует продажи
- Рекомендации: пересмотр маркетинговой стратегии, усиление HR-программ, дополнительный контроль сертификации

#### Критерии оценки выполнения кейса

Критерий	Максимальный балл
Полнота идентификации рисков (не менее 5)	5
Корректность классификации рисков	5
Качественная оценка и тепловая карта	5
Обоснованность выбора методов управления	5
Качество разработки KRI и триггеров	5
Реалистичность контингент-плана	5
Анализ отклонений и корректирующие воздействия	5
Качество рекомендаций совету директоров	5
<b>Итого</b>	<b>40</b>

3 Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций

Процедуры оценивания включают в себя текущий контроль и промежуточную аттестацию.

**Текущий контроль** успеваемости проводится с использованием оценочных средств, представленных в п. 2 данного приложения. Результаты текущего контроля доводятся до сведения студентов до промежуточной аттестации.

**Промежуточная аттестация** проводится в форме экзамена.

Экзамен проводится по расписанию промежуточной аттестации в письменном виде. Количество вопросов в экзаменационном задании – 2 (один вопрос из первой часть и один вопрос из второй части списка вопросов).

Проверка ответов и объявление результатов производится в день экзамена. Результаты аттестации заносятся ведомость и зачетную книжку студента. Студенты, не прошедшие промежуточную аттестацию по графику сессии, должны ликвидировать задолженность в установленном порядке.

## МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

Учебным планом предусмотрены следующие виды занятий:

- лекции;
- лабораторные занятия;

В ходе лекционных занятий рассматриваются основные теоретические вопросы риск-менеджмента, даются рекомендации для самостоятельной работы и подготовки к практическим занятиям.

В ходе лабораторных занятий углубляются и закрепляются знания студентов по ряду рассмотренных на лекциях вопросов, развиваются навыки решения задач по риск-менеджменту.

При подготовке к лабораторным занятиям каждый студент может:

- изучить рекомендованную учебную литературу;
- изучить конспекты лекций по предложенному преподавателем учебнику.

По согласованию с преподавателем студент может подготовить реферат по теме занятия. В процессе подготовки к занятиям студенты могут воспользоваться консультациями преподавателя.

Вопросы, не рассмотренные на лекциях и лабораторных занятиях, должны быть изучены студентами в ходе самостоятельной работы. Контроль самостоятельной работы студентов над учебной программой курса осуществляется в ходе занятий методом тестирования. В ходе самостоятельной работы каждый студент может прочитать основную и по возможности дополнительную литературу по изучаемой теме, дополнить конспекты лекций недостающим материалом, выписками из рекомендованных первоисточников. Выделить непонятные термины, найти их значение в энциклопедических словарях.

### **Методические рекомендации по написанию реферата, требования к оформлению**

Порядок подготовки реферата:

- изучение требований программы дисциплины;
- формулировка цели и задач практического занятия;
- разработка плана проведения практического занятия;
- подбор заданий и вопросов для проведения занятия;
- обеспечение практического занятия методическими материалами, техническими средствами обучения;
- определение методов, приемов и средств поддержания интереса, внимания, стимулирования творческого мышления студентов.

Реферат должен быть нацелен на получение навыков и применения методов риск-менеджмента

1. Вводная часть:

- сообщение темы и цели;
- обобщение теоретических знаний, необходимых для освоения материала.

2. Основная часть:

- разработка плана проведения занятия;
- обзор методов решения практических задач;
- решение практической задачи преподавателем и студентами,
- ответы докладчиков и обсуждение проблемных вопросов.

3. Заключительная часть:

- обобщение и систематизация полученных результатов;
- подведение итогов практического занятия и оценка работы студентов.

Реферат должен быть набран на компьютере (шрифт Times - NewRoman, размер - 14; интервал - 1,5; поля: слева - 2 см, справа - 2 см, сверху и снизу - по 2 см), и правильно оформлен.