

ЕЛЕЦКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ им. И.А. БУНИНА



«УТВЕРЖДАЮ»

И.о. директора института экономики,  
управления и сервисных технологий

 Р.М. Иванова

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**  
**Б1.В.ДВ.01.01 Стратегический анализ и риск-менеджмент**

**Направление подготовки:** 38.04.01 Экономика

**Направленность (профиль):** управление и бизнес-аналитика

**Квалификация (степень):** *магистр*

**Форма обучения:** *очно-заочная*

**Институт:** экономики, управления и сервисных технологий

**Кафедра:** экономики и управления им. Н.Г. Нечаева

		очно-заочная форма	заочная форма
Курс		3	
Семестр/триместр		7	

Лекции		8	
Лабораторные занятия			
Практические (семинарские) занятия		8	
в т. ч. практическая подготовка		4	
Консультации			
Форма(ы) промежуточной аттестации		Экзамен 0,3	
Контроль		9	
Иные формы работы			
Самостоятельная работа		118,7	

**Всего часов:** 144

**Трудоемкость:** 4 зачетные единицы.

Разработчик(и) рабочей программы:

кандидат экономических наук, ст. преподаватель

П.В. Панькин

## I. ОРГАНИЗАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКИЙ РАЗДЕЛ

**Цель изучения дисциплины:** целью изучения дисциплины является формирование у студентов базовых знаний и основных навыков практического применения методов и инструментов современного стратегического анализа как способа определения и развития конкурентных преимуществ компании, а также обеспечение фундаментальной и практической профессиональной подготовки обучающихся в области теории и практики управления рисками, а также освоения методами оценки результативности системы управления рисками.

### **Задачи изучения дисциплины:**

- дать целостное, законченное представление о характере и специфике работы менеджеров по стратегическому управлению, которое опирается на человеческий капитал, ориентирует производственную деятельность организации на запросы потребителей, гибко реагирует на вызовы со стороны окружения и позволяет добиваться повышения конкурентных преимуществ;
- обучить студентов методам и инструментам стратегического анализа, подходам и способам разработки стратегий, их сопряжением друг с другом и достижением общего синергетического эффекта;
- подготовить специалистов-профессионалов, способных на основе полученных знаний творчески, оперативно, обоснованно и с минимальным риском принимать решения по вопросам дальнейшего развития современных предприятий, разрабатывать и реализовывать на практике стратегические и текущие планы, увязывать их с основными управленческими процессами внутри организации, осуществлять постоянный мониторинг за изменениями, происходящими в ее внутренней и внешней среде, и в соответствии с ними вносить необходимые коррективы в комплекс мероприятий по реализации стратегий;
- рассмотреть роли экономических законов и научных подходов в повышении качества и эффективности управления рисками в условиях неопределенности;
- изучить методологии управления рисками;
- изучить технологий процессов определения рискообразующих событий и идентификации рисков;
- сформировать навыков практического использования современных методов мониторинга управления рисками организации и инструментами риск-менеджмента.

**Место дисциплины в структуре ОПОП:** реализуется в рамках вариативной части блока Б1. Дисциплины (модули).

### **Планируемые результаты обучения по дисциплине:**

Код компетенции	Индикаторы достижения компетенции	Планируемые результаты обучения по дисциплине
ПКС-2	<b>Знать:</b> – инновационные методики бизнес-анализа, бизнес-консультирования, способы выявления резервов,	<b>Знает:</b> – методы и модели стратегического анализа макро и микросреды, оценки конкурентоспособности предприятия;

	<p>управления рисками, ресурсами компании, современные коммуникативные технологии для решения профессиональных управленческих задач;</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>– методику стратегического анализа и планирования, оценки внутренних резервов, рынка и конкурентов, проведения прикладных исследований для управления бизнес-процессами;</li> <li>– стратегические направления организационного развития компании, методы разработки и реализации экономико-математических моделей для обоснования принятия управленческих решений.</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>– современные методики стратегического анализа отрасли и работающих в ней организаций;</li> <li>– основные понятия, концепции и методы теории управления рисками;</li> <li>– сущность стратегического риска и неопределенности в процессах принятия решений;</li> <li>– принципы построения систем управления рисками, компоненты системы управления рисками и их взаимосвязь,</li> <li>– этапы разработки систем управления рисками;</li> <li>– национальные и международные стандарты, лучшие практики по построению систем управления рисками</li> </ul>
	<p><b>Уметь:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>– применять современные методы бизнес-анализа, выявлять скрытые резервы, анализировать риски, разрабатывать мероприятия по их минимизации, применять информационные технологии в объеме, необходимом для целей бизнес-анализа;</li> <li>– проводить оценку эффективности бизнес-анализа на основе выбранных критериев, разрабатывать отчетность по проведению бизнес-анализа, применять на практике основные исследовательские инструменты, созданные в рамках отечественной и зарубежной наук;</li> <li>– использовать техники эффективных коммуникаций, количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес-процессами.</li> </ul>	<p><b>Умеет:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>– ориентироваться в стратегических проблемах и целях компании;</li> <li>– осуществлять анализ и разработку стратегии организации;</li> <li>– применять современные методы и передовые научные достижения в стратегическом управлении;</li> <li>– вырабатывать варианты решений поставленных задач и оценивать риски, связанные с их реализацией;</li> <li>– использовать методики анализа и оценки риска деятельности организаций;</li> <li>– оценивать возможность возникновения рисков при реализации неверного управленческого решения.</li> <li>– внедрять системы управления рисками на уровне организации, подразделения, применять термины и принципы риск-менеджмента;</li> <li>– анализировать изменения корпоративной нормативной базы по вопросам управления рисками;</li> <li>– разрабатывать регламентирующие документы по управлению рисками, описывать бизнес-процессы с учетом рисков.</li> </ul>
	<b>Владеть:</b>	<b>Владеет:</b>

	<ul style="list-style-type: none"> <li>– инструментами поиска ресурсного обеспечения для проведения бизнес-анализа, методикой разработки планов и проведения работ по бизнес-анализу, бизнес-консультированию, обеспечение их эффективной реализации;</li> <li>– современными методиками экономического и стратегического анализа среды функционирования, информационными технологиями для решения профессиональных управленческих задач;</li> <li>– навыками оценки эффективности проводимого бизнес-анализа, разработки путей его оптимизации в соответствии с требованиями заинтересованных сторон.</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>– навыками проведения анализа среды компании с использованием инструментов стратегического анализа;</li> <li>– навыками выбора оптимального метода стратегического анализа - навыками оценки и прогнозирования рисков в системе стратегического управления;</li> <li>– навыками исследования влияния факторов внешней и внутренней среды на деятельность</li> <li>– организации;</li> <li>– навыками моделирования рисков-вых ситуаций;</li> <li>– оценивать возможность возникновения рисков при реализации неверного управленческого решения;</li> <li>– навыками определения целей и задач подразделения в соответствии со стратегическими целями организации (декомпозиция стратегических целей организации в задачи подразделения) на основании корпоративных нормативных документов по управлению рисками и требований вышестоящего руководства;</li> <li>– навыками реализации плана построения системы управления рисками</li> </ul>
--	---	---

## II. СОДЕРЖАНИЕ И ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ

с указанием количества часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу

**Очная форма обучения (не реализуется)**

**Очно-заочная форма обучения**

№ п/п	Наименование разделов и тем	Всего	Аудиторные занятия			Сам. раб.
			ЛК	ПЗ	ЛБ	
	<b>Раздел 1. Современный стратегический анализ</b>	<b>48</b>	<b>4</b>	<b>4</b>		<b>40</b>
1.	Тема 1. Концепция современного стратегического анализа	12	1	1		10
2.	Тема 2. Механизм формирования стратегии управления организацией	12	1	1		10
3.	Тема 3. Стратегия как инструмент конкурентоспособного управления	12	1	1		10
4	Тема 4. Реализация стратегии	12	1	1		10
	<b>Раздел 2. Управление финансовыми рисками</b>	<b>86,7</b>	<b>4</b>	<b>4</b>		<b>78,7</b>
4.	Тема 5. Потребность и необходимость управления рисками на предприятии	12	1	1		10
5.	Тема 6. Идентификация и анализ рисков	20				20
6.	Тема 7. Методы управления рисками	12	1	1		10
7.	Тема 8. Потребность и необходимость управления рисками на предприятии	12	1	1		10
8.	Тема 9. Идентификация и анализ рисков	18,7				18,7
9.	Тема 10. Методы управления рисками		1	1		10
	<i>Экзамен</i>	0,3				
	<i>Контроль</i>	9				
	<i>Итого за 7 триместр</i>	144	8	8		118,7
	в т.ч. практическая подготовка:	4	2	2		
	<b>ИТОГО:</b>	<b>144</b>	<b>8</b>	<b>8</b>		<b>118,7</b>

**Заочная форма обучения не реализуется**

## III. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕЙ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Текущая аттестация проводится в форме теста, реферата.

**Типовой вариант теста**

1. Вертикальная интеграция:

- а) увеличивает капитальные вложения в ту отрасль, где работает компания
- б) обеспечивает свободу выбора поставщиков
- в) позволяет использовать опыт фирмы в разных сферах бизнеса

2. Среднесрочным целям соответствует плановый горизонт сроком в:

- а) 5-10 лет
- б) 3-5 лет
- в) 1 год

3. Совокупность способностей работников (знаний, умений, ценностей, навыков и т.д.) и возможностей их раскрытия, развития и использования – это ... потенциал организации:

- а) технологический
- б) экономический
- в) интеллектуальный

4. Одна из стадий технологического процесса стратегического управления:

- а) стадия реализации стратегии
- б) стадия математического анализа
- в) стадия обдумывания стратегии

5. Одна из стадий технологического процесса стратегического управления:

- а) стадия обдумывания стратегии
- б) стадия физического анализа
- в) стадия стратегического анализа

6. Одна из стадий технологического процесса стратегического управления:

- а) стадия обдумывания стратегии
- б) стадия выбора стратегии развития
- в) стадия физического анализа

7. К числу характеристик отраслевой привлекательности при проведении стратегического анализа относится:

- а) нестабильность конкуренции в отрасли
- б) нестабильность спроса
- в) потенциальный размер рынка

8. К числу характеристик отраслевой привлекательности при проведении стратегического анализа относится:

- а) условия конкуренции в отрасли
- б) нестабильность конкуренции в отрасли
- в) политические факторы

9. К числу характеристик отраслевой привлекательности при проведении стратегического анализа относится:

- а) нестабильность спроса
- б) политические факторы
- в) устойчивость и надежность спроса

10. Для таких альянсов характерно заключение соглашения о сотрудничестве между компаниями без их слияния:

- а) политических
- б) стратегических
- в) функциональных

11. Стремление компании к уникальности в каком-либо отношении, важном для клиентов, является:

- а) дифференциацией
- б) дезинтегрированием
- в) дифференциальностью

12. Организации находятся в состоянии постоянного обмена с внешней средой, обеспечивая тем самым себе возможность выживания, так ли это:

- а) отчасти
- б) да
- в) нет

13. Защитная функция риска состоит:

- а) в том, что юридические и физические лица вынуждены искать средства и формы защиты от нежелательной реализации риска
- б) в объективной необходимости законодательного закрепления понятия «правомерности риска», правового регулирования страховой деятельности
- в) оба варианта правильные
- г) нет правильного ответа

14. Ущерб имуществу изначально выражается в:

- а) теоретическом виде
- б) натуральном виде
- в) перспективе

15. Когда велики вероятность возникновения убытков и возможный размер убытка, особенно эффективным является такой метод управления рисками, как:

- а) дублирование риска
- б) передачи риска
- в) отказа от риска

16. Устойчивость проекта оценивается в течение:

- а) расчетного периода
- б) начального инвестиционного периода
- в) одного года

17. Пространственное разделение источников возникновения убытков или объектов, которым может быть нанесен ущерб, предполагает подход к управлению риском:

- а) отказа от риска
- б) снижения частоты ущерба
- в) дифференциация рисков

18. Покрытие убытка на основе нестрахового пула относится к методам:

- а) разделения риска
- б) передачи риска
- в) уклонения от риска

19. Значение вероятности, определяющей рисковый капитал, задает уровень ... риска:

- а) критического
- б) среднего
- в) приемлемого

20. К внешним ограничениям системы управления риском относятся:

- а) конъюнктурные ограничения
- б) институциональные ограничения системы управления риском
- в) бюджетные ограничения системы управления риском

21. Хеджирование является примером метода:

- а) покрытия убытка на основе спонсорства
- б) покрытие убытка на основе нестрахового пула
- в) софинансирования риска на основе договора

22. Принцип управления рисками на уровне фирмы, предусматривающий согласование соответствующих специальных мероприятий с возможностями и условиями функционирования фирмы, означает, что:

- а) система управления риском является частью процедур общего менеджмента фирмы
- б) при управлении риском следует учитывать внешние и внутренние ограничения
- в) процесс управления риском носит динамический характер

### **Примерная тематика рефератов**

1. Предпосылки стратегического управления.
2. Понятие стратегического управления.
3. Этапы развития стратегического управления.



4. Характеристика процесса и основных этапов стратегического управления организацией.
5. Объекты стратегического управления.
6. Особенности построения системы стратегического управления организацией и бизнесом.
7. Первоначальная концепция стратегического управления.
8. Анализ функций специалистов по стратегическому менеджменту и полномочий органов управления организации, принимающих стратегические решения.
9. Проблемы и перспективы использования стратегического управления в отечественных условиях.
10. Виды стратегий организации.
11. Принципы стратегического управления.
12. Структура стратегического потенциала организации.
13. Цели и принципы стратегического анализа внутренней среды.
14. Анализ сильных и слабых сторон предприятия.
15. Стратегический анализ издержек и «цепочка ценностей».
16. Основные факторы внешней среды, влияющие на стратегическое развитие организации.
17. Характеристика и цели анализа внешней среды предприятия.
18. Поиск и анализ стратегических альтернатив развития организации.
19. Pest-анализ микросреды предприятия.
20. Стратегический анализ привлекательности отрасли и инвестиционной привлекательности организации.
21. Анализ общей ситуации и конкуренции в отрасли.
22. Сущность и содержание корпоративной стратегии организации.
23. Роль и оценка преимуществ.
24. Стратегии диверсификации.
25. Методы матричного анализа стратегического портфеля бизнеса.
26. Виды и характеристика корпоративных стратегий.
27. Классификация стратегий организации.
28. Особенности формирования и реализации конкурентных стратегий бизнеса в отраслях, находящихся на различных стадиях жизненного цикла.
29. Основные стратегии развития бизнеса.
30. Определение стратегии предприятия.
31. Связь стратегического анализа с другими формами анализа.
32. Особенности и практика использования стратегического менеджмента на примерах предприятий и организаций.
33. Современные средства контроля и реагирования на возникающие риски.
34. Примеры применения систем контроля рисков на предприятиях.
35. Современные средства коммуникации, применяемые для мониторинга возникновения рисков.
36. Виды и этапы мониторинга рисков.
37. Дополнительные средства, применяемые для мониторинга рисков.
38. Методики расчетов финансовых рисков.

39. Понятие и применение «нестрахового» пула.
40. Кэптивные страховые компании.

Промежуточная аттестация обучающихся осуществляется в форме экзамена с использованием следующих оценочных материалов:

**Вопросы к экзамену  
(7 триместр, очно-заочная форма обучения)**

1. Понятие стратегии. Значение стратегии.
2. Стратегический менеджмент как инструмент и как парадигма.
3. Стратегия предприятия как образ действий
4. Стратегический выбор: задачи, механизмы, ограничения
5. Базовый постулат теории стратегического менеджмента.
6. Подходы к разработке стратегии.
7. Стратегическое планирование (отличия от долгосрочного).
8. Совокупность ориентиров стратегического менеджмента.
9. Цели и задачи организации
10. Уровни целей организации
11. Дерево целей: шаги формирования.
12. Финансовые цели; методика SMART.
13. Заинтересованные стороны организации.
14. Цели и содержание внутреннего анализа компании.
15. Формирование цепочки ценностей
16. Ресурсный анализ
17. Анализ макросреды предприятия
18. SWOT-анализ как инструмент стратегического планирования.
19. Выбор стратегии по модели Портера и модели «тип конкурентного преимущества»
20. Выбор эталонной стратегии.
21. Уровни разработки стратегии.
22. Анализ продуктового портфеля
23. Типы стратегических изменений
24. Система реализации стратегии
25. Структура плана стратегических изменений.
26. Реализация стратегии как регулярный процесс
27. Информация в системе реализации стратегии
28. Организационная культура.
29. Организационная парадигма.
30. Соппротивление изменениям. Способы преодоления изменений
31. Опасности и угрозы.
32. Безопасность и ее виды. Ущерб.
33. Содержание предпринимательского риска.
34. Концепция приемлемого риска.

- 35.Выявление факторов риска.
- 36.Идентификация факторов риска.
- 37.Классификационная схема видов риска в деятельности коммерческих структур.
- 38.Предпринимательские потери и зоны риска.
- 39.Математические модели оценки риска.
- 40.Система показателей оценки риска.
- 41.Оценка риска структуры активов по степени их ликвидности.
- 42.Оценка риска потери платежеспособности.
- 43.Оценка риска потери финансовой устойчивости.
- 44.Непосредственная оценка риска на основе относительных показателей.
- 45.Опосредованная оценка риска на основе относительных показателей.
- 46.Точечная оценка показателя риска.
- 47.Интервальная оценка показателя риска.
- 48.Среднее значение ожидаемого результата деятельности.
- 49.Показатели вариации уровня риска.
- 50.Этап формирования цели и задач экспертного оценивания.
- 51.Выбор метода сбора и отработки экспертной информации.
- 52.Оценка согласованности мнений.
- 53.Факторы финансовой несостоятельности.
- 54.Динамика процесса превращения нормально функционирующего предприятия в банкрот (финансовой несостоятельности).
- 55.Двухфакторная модель прогнозирования банкротства.
- 56.Четырехфакторная модель прогнозирования банкротства.
- 57.Шестифакторная модель прогнозирования риска потери платежеспособности.
- 58.Пятифакторная модель У.Бивера.
- 59.Модели диагностики банкротства предприятия.
- 60.Модели прогнозирования восстановления платежеспособности предприятия.
- 61.Механизмы нейтрализации риска.
- 62.Уклонение от рисков.
- 63.Перенос риска партнерам.
- 64.Приемы снижения степени риска. Распределение риска.
- 65.Диверсификация концентрации риска.
- 66.Лимитирование концентрации риска.
- 67.Самострахование риска.
- 68.Хеджирование риска. Страхование риска.
- 69.Методы компенсации риска.
- 70.Политика управления рисками.

## IV. ПЕРЕЧЕНЬ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

### 4.1. Основная литература

1. Казакова Н. А. Современный стратегический анализ : учебник и практикум для вузов / Н. А. Казакова. — 3-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 469 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-11138-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/489287>
2. Фомичев А. Н. Риск-менеджмент : учебник / А. Н. Фомичев. — 8-е изд., перераб. — Москва : Дашков и К°, 2021. — 366 с. : ил. — (Учебные издания для бакалавров). — Режим доступа: по подписке. — URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=684289>

### 4.2. Дополнительная литература

1. Вяткин В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 365 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-3502-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/489098>
2. Ополченова Е. В. Современный стратегический анализ : учебное пособие : [16+] / Е. В. Ополченова ; Российская международная академия туризма. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Университетская книга, 2016. — 112 с. : ил. — Режим доступа: по подписке. — URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=575004>

## V. ПЕРЕЧЕНЬ РЕСУРСОВ ИНФОРМАЦИОННО-ТЕЛЕКОММУНИКАЦИОННОЙ СЕТИ «ИНТЕРНЕТ», НЕОБХОДИМЫХ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

№ пп	Ссылка на информационный ресурс	Наименование разработки в электронной форме	Доступность
1.	<a href="https://infourok.ru/">https://infourok.ru/</a>	<b>Инфоурок:</b> образовательный интернет-проект России. Включает: конспекты уроков, презентации, тесты, видеоуроки и другие материалы по предметам школьной программы.	Свободный доступ
2.	<a href="http://edu.ru/">http://edu.ru/</a>	<b>Российское образование: Федеральный портал.</b> Включает ссылки на порталы и сайты образовательных учреждений; государственные образовательные стандарты; нормативные документы; каталог экскурсий и обучающих программ.	Свободный доступ

## **VI. СОВРЕМЕННЫЕ ПРОФЕССИОНАЛЬНЫЕ БАЗЫ ДАННЫХ И ИНФОРМАЦИОННЫЕ СПРАВОЧНЫЕ СИСТЕМЫ**

1.	<a href="http://www.biblioclub.ru">http://www.biblioclub.ru</a>	Электронно-библиотечная система (ЭБС) Университетская библиотека онлайн	Регистрация через любой университетский компьютер. В дальнейшем предоставляется неограниченный индивидуальный доступ из любой точки, в которой имеется доступ к сети Интернет
2.	<a href="http://www.garant.ru">www.garant.ru</a>	Информационно-правовой портал	Свободный доступ
3.	<a href="http://www.elibrary.ru">www.elibrary.ru</a>	Российский информационный портал в области науки, технологии, медицины и образования	Свободный доступ
4.	<a href="http://www.consultant.ru">www.consultant.ru</a>	Российская компьютерная справочно-правовая система	Свободный доступ

## **VII. ЛИЦЕНЗИОННОЕ И СВОБОДНО РАСПРОСТРАНЯЕМОЕ ПРОГРАММНОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ**

При реализации учебной дисциплины применяется следующее лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение:

- Microsoft Windows;
- Microsoft Office;
- LibreOffice и др.

## **VIII. ОБОРУДОВАНИЕ И ТЕХНИЧЕСКИЕ СРЕДСТВА ОБУЧЕНИЯ, НЕОБХОДИМЫЕ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ**

Учебные занятия проводятся в аудиториях, укомплектованных специализированной мебелью, в том числе стационарными или переносными техническими средствами обучения (проектор, экран, компьютер/ноутбук).

Самостоятельная работа проводится в кабинетах, оснащенных компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду университета.