

Министерство науки и высшего образования РФ
ФГБОУ ВО «Ульяновский государственный университет»
Инженерно-физический факультет высоких технологий

Кафедра техносферной безопасности

Варнаков Д.В.

МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ СТУДЕНТОВ ПО
ДИСЦИПЛИНЕ «МЕНЕДЖМЕНТ РИСКА»

Ульяновск 2019

Методические указания для самостоятельной работы студентов по дисциплине «Менеджмент риска» / составитель: Д.В.Варнаков. - Ульяновск: УлГУ, 2019.

Настоящие методические указания предназначены для студентов специальности 20.03.01 «Техносферная безопасность» всех форм обучения, изучающих дисциплину «Менеджмент риска». В работе приведены литература по дисциплине, основные темы курса и вопросы в рамках каждой темы, рекомендации по изучению теоретического материала, контрольные вопросы для самоконтроля и тесты для самостоятельной работы.

Студентам очно-заочной формы обучения следует использовать данные методические указания при самостоятельном изучении дисциплины. Студентам очной формы обучения они будут полезны при подготовке к практическим занятиям и к зачету по данной дисциплине

Рекомендованы к использованию ученым советом Института ИФФВТ УлГУ Протокол № 11 от «18» июня 2019 г.

1.ЛИТЕРАТУРА ДЛЯ ИЗУЧЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

1. Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент : учебник для бакалавров / А. Н. Фомичев. - 4-е изд. - Москва : Дашков и К, 2016. - 372 с. - ISBN 978-5-394-02676-8. - Текст : электронный // ЭБС "Консультант студента" : [сайт]. - URL : <https://www.studentlibrary.ru/book/ISBN9785394026768.html>
2. Марченко, Б. И. Анализ риска : основы управления рисками : учебное пособие / Б. И. Марченко. - Ростов н/Д : ЮФУ, 2019. - 122 с. - ISBN 978-5-9275-3124-0. - Текст : электронный // ЭБС "Консультант студента" : [сайт]. - URL : <https://www.studentlibrary.ru/book/ISBN9785927531240.html>

2.МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ

Тема 1. Основные понятия управления рисками

Основные вопросы темы:

1. Риск. ([1] глава 1).
2. Вероятность рисков ([1] глава 1).

Контрольные вопросы:

1. Неопределенность.
2. Случай, вероятность и воздействие

Кейсы и тесты для самостоятельной работы

- а) проработайте кейсы 1.1. по учебному пособию [2].
- б) ответьте на тестовые вопросы

1. *Риск – это...*

- 1.разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели
- 2.наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна
- 3.следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера

2. *Идентификация риска – это...*

- 1.систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия
- 2.начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик
- 3.систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты

Тема 2. Методы определения вероятности и последствий рисков

Основные вопросы темы:

1. Сущность статистических методов и моделей определения и оценки рисков предприятия.
2. Математико-статистические показатели риска ([1] глава 2).

Контрольные вопросы:

3. Вариация, ковариация, корреляция.

Среднеквадратическое отклонение от среднего

Кейсы и тесты для самостоятельной работы

- а) проработайте кейсы 2.1. по учебному пособию [2].
 - б) ответьте на тестовые вопросы
2. *Отметьте потери, которые можно отнести к трудовым*
- 1.потери рабочего времени
 - 2.уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию
 - 3.уплата дополнительных налогов
 - 4.невыполнение сроков сдачи объекта

Тема 3. Стратегии решений в условиях риска

Сущность аналитических методов и моделей определения и оценки рисков предприятия. Игровые модели. Метод анализа целесообразности затрат. Методы расчета и анализа основных показателей финансово-хозяйственной деятельности предприятия. Модели по определению и оценке риска банкротства предприятия. Положительные и отрицательные стороны аналитических методов.

Дерево решений. Планирование управления рисками. Особенности управления рисками нефтегазовых проектов. Современная концепция управления рисками проектов. Общие требования к системам управления рисками проектов.

Основные вопросы темы:

1. Сущность аналитических методов и моделей определения и оценки рисков предприятия. ([2] глава 2).
2. Дерево решений ([1] глава 2).

Контрольные вопросы:

4. Положительные и отрицательные стороны аналитических методов.

Современная концепция управления рисками.

Кейсы и тесты для самостоятельной работы

- а) проработайте кейсы 3.1. по учебному пособию [1].
 - б) ответьте на тестовые вопросы
3. *Отметьте потери, которые можно отнести к финансовым*
- 1.потери ценных бумаг
 - 2.потери сырья
 - 3.невыполнение сроков сдачи объекта
 - 4.выплата штрафа
 - 5.уплата дополнительных налогов
 - 6.ущерб репутации
 - 7.ущерб здоровью
 - 8.потери материалов
 - 9.потери рабочего времени
 - 10.уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

Тема 4. Обработка рисков

Основные вопросы темы:

1. Система управления рисками и отчетность. ([1] глава 2).
2. Финансовый риск проекта ([2] глава 1).

Контрольные вопросы:

5. Дисконтированная оценка доходности проекта.
6. Страхуемые и нестрахуемые риски.

Кейсы и тесты для самостоятельной работы

- а) проработайте кейсы 4.1. по учебному пособию [2].
 - б) ответьте на тестовые вопросы
3. *Отметьте потери, которые можно отнести к потерям времени.*
 1. невыполнение сроков сдачи объекта
 2. потери ценных бумаг
 3. выплата штрафа
 4. уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

Тема 5. Методы теории игр

Основные вопросы темы:

1. Классификация методов управления риском. ([1] глава 2).
2. Подходы к разработке методов управления риском ([1] глава 1).

Контрольные вопросы:

3. Этапы управления риском (идентификация и анализ подверженности риску, включая методы количественной оценки риска; анализ альтернативных методов управления риском; выбор методов управления риском; использование выбранного метода управления риском; мониторинг результатов и совершенствование системы управления риском).
4. Стратегии управления риском.

Кейсы и тесты для самостоятельной работы

- а) проработайте кейсы 5.1. по учебному пособию [2].
 - б) ответьте на тестовые вопросы
5. *Отметьте потери, которые можно отнести к специальным потерям*
Отметьте потери, которые можно отнести к специальным потерям
 1. выплата штрафа
 2. ущерб здоровью
 3. уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию
 4. потери ценных бумаг
 5. потери сырья
 6. уплата дополнительных налогов
 7. ущерб репутации
 8. невыполнение сроков сдачи объекта

Тема 6. Анализ чувствительности проекта

Основные вопросы темы:

1. Метод вариации параметров: инвестиционные затраты ([1] глава 3).
2. Относительный и абсолютный анализ чувствительности проекта ([1] глава 2).

Контрольные вопросы:

3. объем производства.
4. длительность расчетного периода

Кейсы и тесты для самостоятельной работы

- а) проработайте кейсы 6.1. по учебному пособию [2].
 - б) ответьте на тестовые вопросы
5. *Анализ риска – это...*
1. систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия
 2. систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты
 3. начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик

Тема 7. Методы минимизации проектных рисков

Основные вопросы темы:

1. Факторный анализ себестоимости ([1] глава 3).
2. Анализ резервов снижения себестоимости продукции ([1] глава 3).

Контрольные вопросы:

3. Задачи анализа затрат на производство.
4. Задачи анализа затрат на реализацию продукции предприятий

Кейсы и тесты для самостоятельной работы

- а) проработайте кейсы 7.2. по учебному пособию [2].
 - б) ответьте на тестовые вопросы
5. *Риски, которые могут нести в себе как потери, так и дополнительную прибыль, называются*
1. чистыми
 2. критическими
 3. спекулятивными

Тема 8. Планирование реагирования на риски, мониторинг и контроль рисков

Основные вопросы темы:

1. Избежание и лимитирование рисков ([1] глава 3).
2. Передача и хеджирование рисков ([2] глава 2).

Контрольные вопросы:

3. Применение самострахования.
4. Сравнительная оценка экономической эффективности страхования и самострахования, метод Хаустона
5. **Кейсы и тесты для самостоятельной работы**
 - а) проработайте кейсы 8.1. по учебному пособию [2].
 - б) ответьте на тестовые вопросы
6. *Последствия риска могут быть*
 1. скорее положительными
 2. как положительными, так и отрицательными
 3. только отрицательными

Тема 9. Оценка экономического эффекта от управления рисками

Основные вопросы темы:

1. Управление кредитными рисками ([1] глава 4).
2. Оформление и контроль за исполнением кредитной сделки ([1] глава 4).

Контрольные вопросы:

3. Управление операционными рисками.
4. Сценарный анализ

Кейсы и тесты для самостоятельной работы

- а) проработайте кейсы 9.1. по учебному пособию [2].
 - б) ответьте на тестовые вопросы
5. *Что является объектом управления в риск-менеджменте?*
1. риск, рисковые вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами
 2. все варианты верны
 3. специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками