

МИНИСТЕРСТВО СЕЛЬСКОГО ХОЗЯЙСТВА РОССИЙСКОЙ
ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего профессионального образования
«Якутская государственная сельскохозяйственная академия»
Экономический факультет
Кафедра «Менеджмент»

**МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ
ПО ВЫПОЛНЕНИЮ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ СТУДЕНТОВ**

Дисциплина (модуль)
БЗ.В.ДВ.4.2 – Риск-менеджмент
шифр и название по учебному плану

Специальность (образовательная программа)
080200 – Менеджмент
шифр и наименование

Специализация (профиль)
«Производственный менеджмент»
шифр и наименование

СРС, направленная на углубление и закрепление знаний бакалавра, развитие практических умений.

Текущая самостоятельная работа включает следующие виды работ:

- работа с лекционным материалом, поиск и обзор литературы и электронных источников информации по индивидуально заданной проблеме курса и выбранной теме магистерской диссертации;
- выполнение индивидуальных домашних заданий, домашних контрольных работ;
- опережающая самостоятельная работа;
- изучение тем, вынесенных на самостоятельную проработку;
- подготовка к практическим занятиям;
- подготовка к контрольным работам и устным опросам, к экзамену.

Творческая проблемно-ориентированная самостоятельная работа (ТСР), направленная на развитие интеллектуальных умений, комплекса универсальных (общекультурных) и профессиональных компетенций, повышение творческого потенциала бакалавров.

ТСР включает следующие виды работ по основным проблемам курса:

- поиск, анализ, структурирование и презентация информации;
- выполнение расчетно-графических работ;
- выполнение курсовой работы;
- исследовательская работа и участие в научных студенческих конференциях, семинарах и олимпиадах;
- анализ научных публикаций по заранее определенной преподавателем теме;
- анализ статистических и фактических материалов по заданной теме, проведение расчетов на основе статистических материалов.

Содержание самостоятельной работы бакалавров по дисциплине

Тематическое содержание самостоятельной работы:

1. Перечень научных проблем и направлений научных исследований

1. Возможности достижения стратегических целей компании в условиях риска.
2. Стратегия и политика управления рисками компании.
3. Цикл управления рисками компании
4. Составление карты рисков на основе составленного регистра рисков.
5. Взаимосвязь внутреннего контроля и управления рисками.
6. Формирование отчетности по управлению рисками.
7. Мониторинг эффективности управления рисками.
8. Мероприятия по управлению рисками.
9. Реагирование на риск.
10. Подходы к управлению рисками.
11. Контроль эффективности реагирования на риск.
12. Оценка рисков. Анализ «аппетита» на риск.
13. Методы расчета уровня толерантности к рискам.
14. Классификация рисков.
15. Качественная оценка рисков.
16. Инструменты оценки рисков.
17. Количественное измерение рисков.
18. Методы измерения рисков.
19. Анализ инвестиционной ситуации.
20. Принятие решений по инвестиционным проектам.
21. Методы оценки эффективности инвестиционных проектов.
22. Анализ экстремальных факторов, влияющих на кадровую политику при управлении проектами.
23. Инвестиционный проект.
24. Комплексный анализ инвестиционных проектов
25. Моделирование технико-экономических показателей при формировании нормативов бурения.

26. Оптимизация рисков инвестиционной деятельности на поздних стадиях эксплуатации нефтяных месторождений.

27. Организация управления проектами.

28. Оценка и анализ рисков инвестиционных проектов.

29. Разработка и оценка эффективности инвестиционного проекта.

30. Расчет эффективности проекта по методу NPV.

31. Теоретические основы анализа инвестиционных проектов.

2. *Темы индивидуальных заданий*

1. Эволюция взглядов на категории «риск».

2. Выбор инвестиционного портфеля в условиях неопределенности и риска.

3. Предпосылки и факторы, предшествующие наступлению рискованных ситуаций.

4. Сущность и содержание риск-менеджмента.

5. Анализ и оценка уровня риска.

6. Методы уклонения от риска и его компенсации.

7. Методы управления финансовым риском.

8. Классификация рисков.

9. Роль Банка России в управлении банковскими рисками.

10. Способы снижения процентного и кредитного риска.

11. Понятие и классификация рисков в страховом бизнесе.

12. Концепция рискованности стоимости (Value at risk – VAR).

13. Организация управления риском на производственном предприятии.

14. Метод статистических испытаний (Monte-Carlo simulation).

15. Хеджирование рисков.

16. Управление кредитным риском в деятельности банков.

17. Статистические методы оценки риска.

18. Критерий ожидаемой полезности.

19. Риски в международной банковской деятельности.

20. Этапы управления риском.
21. Аутсорсинг управления риском.
22. Методы финансирования рисков.
23. Пороговые значения риска.
24. Общая характеристика информации, необходимой для управления риском.
25. Идентификация и анализ рисков.
26. Меры по предотвращению неплатежеспособности и несостоятельности российских предприятий.
27. Реструктуризация предприятия: подходы и решения.
28. Правовое регулирование отношений в сфере несостоятельности (банкротства).
29. Анализ результатов развития предприятия в условиях быстро меняющейся внешней среды.
30. Пути реструктуризации предприятия с учетом зарубежного опыта.
31. Взгляды экономистов на теорию циклов и кризисов.
32. Методы антирискового регулирования экономики.
33. Причины, факторы и симптомы кризисного развития экономики.
34. Диагностика банкротства предприятий.
35. Зарубежная практика риск-менеджмента.
36. Основные стратегии вывода предприятия из кризиса.
37. Классификация антикризисных стратегий.
38. Меры по восстановлению платежности должника.
39. Выбор оптимального объема производства в условиях неопределенности спроса.
40. Институциональные особенности принятия решений в переходной экономике.
41. Стратегия и тактика риск-менеджмента.

3. Темы, выносимые на самостоятельную проработку

1. Как рассчитывается коэффициент риска и определяются возникающие проблемы управления риском на предприятии?
2. Какие базовые финансовые документы необходимо использовать для получения информации с целью управления риском?
3. Назовите характерные отличия чистых рисков от спекулятивных.
4. Охарактеризуйте группы транспортного риска по степени ответственности.
5. Что подразумевают риски неисполнения хозяйственных договоров и селективные риски?
6. Как правильно осуществлять обнаружение рисков при помощи качественного анализа?
7. Какую информацию о рисках необходимо получать при помощи количественной оценки?
8. По каким критериям необходимо идентифицировать внешние и внутренние источники информации?
9. Какие требования необходимо предъявлять к информации о рисках?
10. Как осуществлять визуализацию рисков путем сравнения распределения ущерба до реализации какого-либо предупредительного мероприятия и соответствующего распределения после его осуществления?
11. Каким образом следует определять границу между приемлемым и неприемлемым рисками?
12. Охарактеризуйте экономическую (коммерческую) и политическую неопределенности.
13. Определите степень риска при помощи количественных и качественных методов оценки рисков.
14. Рассчитайте ожидаемую норму доходности ERR и IRR—внутреннюю норму доходности.
15. Какие экспертные методы применяются при определении возможности наступления рискованных ситуаций?

16. При помощи каких показателей определяется доверительный интервал и временной горизонт при оценке (VaR)?

17. Какие практические меры используются при управлении информационными рисками?

18. Как правильно разработать и довести до подчиненных план действий в случае критической ситуации возникновения информационных рисков?

19. По каким критериям осуществлять выбор методов управления риском?

20. Как проводится оценка рискованности объекта размещения ресурсов банка?

21. Охарактеризуйте превентивные и поддерживающие мероприятия риск-стратегий.

22. При помощи каких методов следует осуществлять выбор оптимального инвестиционного проекта?

23. Для чего используются рейтинговые значения двухуровневых вероятностей окупаемости инвестиций?

24. Что характеризуют показатели ковариационной матрицы доходов?

Контроль самостоятельной работы

Оценка результатов самостоятельной работы организуется как единство двух форм: самоконтроль и контроль со стороны преподавателя.

Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов

Образовательные ресурсы для использования при самостоятельной работе бакалавров, в том числе программное обеспечение и Internet-ресурсы, учебные и методические пособия, задачки и др., рекомендованы в п.8 настоящей рабочей программы.