

Федеральное государственное образовательное бюджетное учреждение
высшего образования
**«ФИНАНСОВЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПРИ ПРАВИТЕЛЬСТВЕ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»**
(Финансовый университет)

Уральский филиал Финуниверситета

Кафедра «Экономика, финансы и управление»

А.А. Копченков

Риск-менеджмент

Методические указания по выполнению контрольной работы
для студентов, обучающихся по направлению
по направлению 38.03.02 «Менеджмент»
образовательная программа «Управление бизнесом»
профиль «Менеджмент организации»

*Одобрено кафедрой «Экономика, финансы и управление»
протокол № 6 от 14.02.2023 г.*

Челябинск 2023

УДК 658.24 (078)

Рецензенты:

Е.А. Захарова, профессор кафедры экономических методов в экономике ФГБОУ ВО «ЧелГУ», доктор экономических наук,

Н.А. Калмакова, доцент кафедры «Экономика, финансы и управление», кандидат экономических наук

Риск-менеджмент. Методические указания по выполнению контрольной работы по дисциплине для подготовки бакалавров по направлению 38.03.02 «Менеджмент», образовательная программа «Управление бизнесом», очная форма обучения – Челябинск: Финансовый университет (Уральский филиал), кафедра «Экономика, финансы и управление», 2023. – 15 с.

Учебно-методическое издание

Алексей Александрович Копченов

Риск-менеджмент

Методические указания по выполнению контрольной работы по дисциплине

Компьютерный набор, верстка: А.А. Копченов

Отпечатано в Челябинском филиале Финансового университета

© Копченов А.А., 2023

© Финансовый университет, 2023

СОДЕРЖАНИЕ

Введение.....	4
Порядок выбора и утверждения темы.....	5
Организация и контроль за выполнением контрольных работ.....	5
Подбор и изучение источников.....	6
Структура и содержание контрольной работы.....	8
Подготовка тезисов доклада для защиты.....	10
Защита контрольных работ.....	10
Примерная тематика контрольных работ.....	11
Рекомендуемый библиографический список.....	12
Приложения.....	15

ВВЕДЕНИЕ

В соответствии с учебным планом подготовки бакалавров студенты, обучающиеся по направлению 38.03.02 «Менеджмент», образовательная программа «Управление бизнесом», профиль «Менеджмент организации», должны выполнить контрольную работу по дисциплине «Риск-менеджмент» и представить ее к сроку, установленному учебным графиком.

Контрольная работа является одним из основных видов самостоятельной работы студентов в ВУЗе, направленной на: закрепление, углубление и обобщение знаний по базовой учебной дисциплине профессионального цикла; овладение методами научных исследований; формирование навыков решения поставленных задач в ходе научного исследования; умение творчески использовать полученные знания.

Контрольная работа – это документ, представляющий собой форму отчетности по самостоятельной работе студента, содержащий систематизированные сведения по определенной теме.

Целью выполнения контрольной работы является формирование навыков самостоятельного творческого решения профессиональных задач.

Задачами выполнения контрольной работы являются систематизация, закрепление, углубление и расширение приобретенных студентом знаний, умений, навыков по учебной дисциплине.

В процессе написания и защиты контрольной работы студенты должны проявить знание изученного материала; продемонстрировать умение работать с литературными источниками, способность анализировать, обобщать информацию; принимать управленческие решения на основе сделанных выводов; логически и чётко излагать материал.

Тема контрольной работы выбирается на основании предлагаемой тематики по согласованию с руководителем. Для написания проблемно-аналитической части работы рекомендуется использовать данные организаций, сведения из специальной научной отечественной и зарубежной литературы.

1 ПОРЯДОК ВЫБОРА И УТВЕРЖДЕНИЯ ТЕМЫ

При выборе темы контрольной работы студент должен, прежде всего, ориентироваться на свои научные интересы, предполагая, что данная работа может участвовать в конкурсах научных работ всех уровней и должна служить основой написания выпускной квалификационной работы бакалавра.

Примерная тематика контрольных работ по дисциплине «Риск-менеджмент» представлена в п. 7 данных методических указаний.

Студент имеет право выбрать одну из предлагаемых тем, либо, по согласованию с научным руководителем, возможна корректировка темы или утверждение инициативной темы студента, имеющей практическую значимость и перспективы дальнейшего исследования данной проблемы.

Закрепление темы контрольной работы за студентом утверждается научным руководителем.

2 ОРГАНИЗАЦИЯ И КОНТРОЛЬ ЗА ВЫПОЛНЕНИЕМ КОНТРОЛЬНЫХ РАБОТ

Студент выполняет контрольную работу под руководством научного руководителя в соответствии с утвержденным графиком.

В обязанности научного руководителя контрольной работы входит:

- оказание консультационной помощи студенту в определении окончательной темы работы, в подготовке плана, в подборе литературы и фактического материала;
- содействие в выборе методики исследования;
- осуществление систематического контроля за ходом выполнения работы в соответствии с планом и сроками ее выполнения;
- оценка качества выполнения работы в соответствии с предъявляемыми к ней требованиями.

При выполнении контрольной работы студент должен:

- собрать информацию по теме;
- изучить и проанализировать собранные материалы;
- систематизировать и обобщить имеющуюся информацию;
- самостоятельно решить поставленные задачи;
- логически обосновать и сформулировать выводы, предложения и рекомендации.

Студент как автор контрольной работы несет ответственность за достоверность всей информации, содержащейся в работе, и соблюдение сроков ее представления.

Готовая контрольная работа на электронном и бумажном носителях представляется на проверку научному руководителю на кафедру не позднее, чем за три недели до установленного срока защиты. Проверка работы перед защитой является обязательной. Работа проверяется руководителем в течение 10-14 дней и возвращается студенту подписанной и допущенной к защите. При незначительных замечаниях студентом вносятся исправления. Контрольная работа не допускается к защите в случаях непредставления работы на проверку в установленный срок, грубых нарушений правил оформления контрольной работы. Спорные вопросы, связанные с выполнением контрольной работы, решаются совместно студентом и научным руководителем. При невозможности принять согласованное решение вопрос решается единолично заведующим кафедрой либо выносится на обсуждение на заседание кафедры.

3 ПОДБОР И ИЗУЧЕНИЕ ИСТОЧНИКОВ

Важным условием успешного выполнения контрольной работы является правильный подбор и изучение студентом материалов, отражающих содержание излагаемой темы. Для написания контрольной работы рекомендуется изучить не менее 15 источников.

Все материалы, используемые в процессе выполнения работы, можно условно разделить на теоретические и практические.

К теоретическим материалам относятся:

- законодательные акты, нормативные документы, материалы государственных органов;
- учебная, научная и методическая литература, книги, брошюры по специальным вопросам

К практическим материалам относятся:

- статистические сборники, справочники, журналы и газетные статьи;
- материалы государственных органов власти и местного самоуправления, предприятий, домашних хозяйств.

В методических указаниях содержится рекомендуемый библиографический список для контрольной работы, который содержит перечень основных источников. Кроме того, необходимо использовать в качестве дополнительных источников новейшие источники по специальным вопросам, которые не вошли в данный список, а также информационные ресурсы сети Интернет. Рекомендуется ознакомиться и с публикациями, освещающими зарубежный опыт по изучаемым вопросам в российских и зарубежных периодических изданиях.

Весь собранный теоретический материал должен быть хорошо изучен, проанализирован и творчески использован в выполняемой работе. Не допускается механическое заимствование текста из литературных источников. Все приводимые в работе цитаты, заимствования и цифровые данные, полученные другими авторами, должны иметь ссылки на источники. Контрольная работа должна содержать практические материалы по изучаемой теме, иллюстрирующие приводимые студентом положения и сделанные на их основе выводы.

Все приводимые в работе данные (таблицы, рисунки) должны быть тщательно проанализированы, прокомментированы, логически увязаны с темой работы и использованы для обоснования выводов и предложений.

4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ КОНТРОЛЬНОЙ РАБОТЫ

При написании контрольной работы студент должен разобраться в теоретических вопросах избранной темы, самостоятельно проанализировать собранный практический материал, разработать и обосновать предложения, направленные на совершенствование предмета исследования. Решение поставленных задач определяет содержание контрольной работы.

Структура контрольной работы должна включать:

- Содержание;
- Обоснование актуальности выбранной темы (проблемы);
- Описание цели и задачи работы;
- Обозначение объекта и предмета исследования (во введении);
- Перечень поставленных задач (проблем) (во введении);
- Выполненное в электронном виде и на печатном носителе задание;
- Обобщенные выводы по результатам проведенного исследования (выполненных расчетов, обоснования);
- Список использованной литературы;
- Приложения (включая картографический материал), в том числе распечатка презентации (при наличии).

Достоверность используемых в работе источников информации должна подтверждаться ссылками на источники информации, включая периодические научные и научно-практические издания, нормативно-правовую базу, информационно-правовые порталы и официальные базы данных.

Титульный лист является первым листом работы (нумерация на нем не проставляется). Титульный лист должен содержать все установленные реквизиты (Приложение А).

Содержание включает перечень наименований всех разделов и подразделов работы с указанием номеров страниц, на которых размещается начало материала. Содержание дает наглядное представление о структуре и основных проблемах, освещаемых в работе, позволяет ориентироваться в ней.

Во введении кратко обосновывается целесообразность выбора темы контрольной работы, ее значимость и актуальность, степень изученности в отечественной и мировой теории и практике. Должны быть четко определены объект, предмет, цель исследования и сформулированы задачи исследуемой проблемы. Объем введения не должен превышать трех страниц печатного текста.

Основная часть работы делится на разделы и подразделы. Каждый элемент основной части (раздел, подраздел) должен представлять собой законченный в смысловом отношении фрагмент работы. В структуре основной части должно быть выделено не менее двух разделов, а в их составе не менее двух подразделов.

Основная часть работы начинается с обзора литературы по выбранной тематике, в котором полно и систематизировано излагается состояние вопроса, проводится анализ нормативных и законодательных актов, данных учебной и специальной литературы, периодической печати. Обзор литературы предполагает сравнение и сопоставление мнений отечественных и зарубежных авторов по исследуемому вопросу, оценку противоречивых сведений, содержащихся в различных информационных источниках.

Расчетно-аналитическая часть оформляется после основной части.

В заключении кратко формулируются основные выводы и рекомендации по результатам исследования. Объем заключения составляет не более трех страниц.

На последней странице заключения студент проставляет дату окончания работы и подпись.

Список использованных источников отражает степень изученности студентом рассматриваемой проблемы.

Приложение содержит вспомогательные материалы: копии документов предприятия, громоздкие таблицы и расчеты, первичные и справочные материалы, иллюстрации вспомогательного характера и другие материалы.

Общий объем работы должен составлять примерно 15-20 страниц текста.

Оформление контрольной работы должно соответствовать утвержденным в филиале методическим указаниям «Правила оформления контрольных работ, контрольных проектов, научных и выпускных квалификационных работ»

Неправильно или небрежно оформленная контрольная работы не рецензируется и возвращается студентам для переоформления (<http://www.fa.ru/fil/chelyabinsk/org/chair/mi/Documents/Правила%20оформления%20письменных%20работ%20%281%29.pdf>).

5 ПОДГОТОВКА ТЕЗИСОВ ДОКЛАДА ДЛЯ ЗАЩИТЫ

Для защиты студент должен заранее подготовить тезисы доклада. В докладе студент за отведенное время (5-7 минут) должен осветить актуальность и значимость выбранной темы, объект, предмет, цель работы и поставленные задачи, раскрыть сущность исследуемого вопроса и подвести итоги проведенной работы. При необходимости следует пояснить структуру работы и логику изложения материала. Целесообразно указать, какие материалы послужили основой работы и каков период исследования.

6 ЗАЩИТА КОНТРОЛЬНЫХ РАБОТ

Защита контрольной работы носит публичный характер и включает доклад студента и ответы на вопросы по теме работы, задаваемые как руководителем работы, так и присутствующими на защите лицами.

Решение об оценке контрольной работы принимается руководителем работы с учетом объема и качества работы, степени раскрытия выбранной темы, соблюдения требований, предъявляемых к оформлению работы и уровня защиты работы.

Студенты, получившие при защите контрольной работы неудовлетворительную оценку, должны произвести необходимую доработку и подготовить подробный доклад для повторной защиты.

7 ПРИМЕРНАЯ ТЕМАТИКА КОНТРОЛЬНЫХ РАБОТ

В зависимости от содержания контрольная работа выполняется в составе группы (или самостоятельно).

С разрешения кафедры студент может самостоятельно выбрать тему контрольной работы с учетом специфики своих профессиональных или научных интересов.

1. Понятие риска в научном и прикладном значениях
2. Субъективная основа предпринимательского риска. Типы отношения к риску ЛПР
3. Различие между чистыми и спекулятивными рисками.
4. Выявление потенциальных областей риска, диагностика и оценка возможности предотвращения или минимизации возникновения рисков
5. Управленческие инструменты и механизмы, обеспечивающие эффективную диагностику рисков.
6. Определение рискового спектра компании. Понятия: рисковое поле, рисковый ландшафт, рисковый профиль
7. Установление актуального рискового профиля
8. Метод сценариев оценки риска
9. Оценка влияния каждого показателя по методу дерева решений в управлении риском
10. Метод Монте–Карло (статистических испытаний)
11. Методы экспертных оценок риска. Метод "Дельфи".
12. Координация (согласование) мнений экспертов.
13. Что представляет собой расчет индекса Трейнора. С какой целью он рассчитывается
14. Размер премии за риск инвестирования в акционерный капитал, ERP -Implied Equity Risk Premium
15. Избежание риска как наиболее простой метод управления рисками, выбор мероприятий
16. Принятие (сохранение) риска, оправданность выбора
17. Принципы стратегии риск-менеджмента: принцип максимизации, принцип

минимизации, принцип адекватности, принцип принятия

18. Правила стратегии риск-менеджмента: максимум выигрыша, оптимальная вероятность результата, оптимальная колеблемость результата, оптимальное сочетание выигрыша и величины риска.

19. Эвристические правила риск – менеджмента

20. Особенности и цели проведения финансового анализа рисков корпоративных организаций

21. Факторы, влияющие на уровень финансовых рисков корпорации: объективные и субъективные.

22. Финансовое состояние корпорации и риск банкротства. Основные направления восстановления платежеспособности и снижения риска банкротства корпорации.

23. Определение предельно допустимого уровня финансовых рисков по отдельным финансовым операциям и видам финансовой деятельности корпорации

24. Риски корпоративного управления и государственного регулирования

25. Нефинансовые риски корпорации при принятии инвестиционных решений

26. Риски технико-технологических преобразований и реформирования организационно - правовой структуры корпорации

27. Риски инновационно- инвестиционной деятельности. Источники

28. Этапы и организация риск – менеджмента инвестиционного проекта

29. Анализ чувствительности критериев эффективности. Метод сценариев

8 РЕКОМЕНДУЕМЫЙ БИБЛИОГРАФИЧЕСКИЙ СПИСОК

Нормативные правовые акты

1. Гражданский кодекс Российской Федерации, часть I от 30.11.1994 г.

№ 51-ФЗ (принята ГД ФС РФ 21.10.1994 г., действующая редакция).

2. Гражданский кодекс Российской Федерации, часть IV от 18.12.2006 г.

№ 230-ФЗ (принята ГД ФС РФ 24.11.2006 г., действующая редакция).

3. Закон об акционерных обществах от 26.12.1995 №208-ФЗ, с изменениями и дополнениями с 1 января 2017 г. Конституция Российской Федерации (принята на всенародном голосовании 12 декабря 1993 г.) (с поправками).

4. ГОСТ 1.1-2002 «Межгосударственная система стандартизации. Термины и определения».

5. ГОСТ Р 51897 – 2002 «Менеджмент риска. Термины и определения».

Основная литература:

1. Антонов, Г. Д. Управление рисками организации : учебник / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. — Москва : ИНФРА-М, 2020. — 153 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). —URL:

<https://ezpro.fa.ru:3339/catalog/product/1052461>

2. Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент : учебник для бакалавров / А. Н. Фомичев. — 7-е изд. — Москва : Дашков и К°, 2020. — 372 с. — URL:

<https://ezpro.fa.ru:3339/catalog/product/1091116>

3. Окулов, В. Л. Риск-менеджмент : основы теории и практика применения : учебное пособие / В. Л. Окулов. — Санкт-Петербург : Изд-во С.-Петерб. ун-та, 2019. — 280 с. — URL: <https://ezpro.fa.ru:3339/catalog/product/1080924>

Дополнительная литература:

6. Баранников, А.Л., Риск-менеджмент. : учебное пособие / А.Л. Баранников, М.В. Данилина. — Москва : Русайнс, 2023. — 332 с. —URL:

<https://book.ru/book/945969>

7. Гончаренко, Л.П., Риск-менеджмент : учебное пособие / Л.П. Гончаренко, Сергей Александрович. Филин, ; под ред. Е.А. Олейникова. — Москва : КноРус, 2022. — 215 с. — URL: <https://book.ru/book/941788>

8. Шапкин А.С. Теория риска и моделирование рисков ситуаций : учебник / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. — 6-е изд. — Москва : Дашков и К, 2017. — 880 с. — (Учебные издания для бакалавров). — ЭБС Znanium.com. — URL:

<http://znanium.com/catalog/product/450763> (дата обращения: 10.10.2019). – Текст: электронный.

9. Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент : учебник для бакалавров / А. Н. Фомичев. – 7-е изд. – Москва : Дашков и К°, 2020. – 372 с. – URL: <https://ezpro.fa.ru:3339/catalog/product/1091116>

10. Шапкин А.С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций / А.С. Шапкин, В.А. Шапкин. – 9-е изд. – Москва : Дашков и К, 2018. – 544 с. – ЭБС Znanium.com. – URL: <http://znanium.com/catalog/product/339372> (дата обращения: 10.10.2019). – Текст : электронный.

**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
БЮДЖЕТНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
ФИНАНСОВЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ПРИ ПРАВИТЕЛЬСТВЕ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
УРАЛЬСКИЙ ФИЛИАЛ**

Кафедра «Экономика, финансы и управление»

Контрольная работа

по дисциплине:

«Риск-менеджмент»

Вариант № ____

Тема - *

Студент: Фамилия И.О.

Группа:

Направление:

Профиль:

Личное дело № ***.*/*****

Преподаватель: должность, Фамилия И.О.

Челябинск 202__