

МИНИСТЕРСТВО СЕЛЬСКОГО ХОЗЯЙСТВА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Санкт-Петербургский государственный аграрный университет»

Кафедра технологии управления и сервиса

МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ ОБУЧАЮЩИХСЯ

ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ
«УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ»

38.04.01 Экономика

(код и наименование направления подготовки магистра)

Академическая магистратура

(прикладная магистратура, академическая магистратура)

Аграрная экономика

(наименование профиля подготовки)

Форма обучения
Очно-заочная

Санкт-Петербург
2022

Автор

Доцент

(должность)



(подпись)

Лаврова А.П.

(Фамилия И.О.)

Рассмотрено на заседании кафедры технологии управления и сервиса
от 15 марта 2022 г., протокол № 8.

Заведующий кафедрой

(подпись)



Донец Н.Ю.

(Фамилия И.О.)

СОДЕРЖАНИЕ

	с.
1 Цель самостоятельной работы	4
2 Задачи самостоятельной работы	4
3 Трудоемкость самостоятельной работы	4
4 Формы самостоятельной работы	4
5 Структура самостоятельной работы	4
6 Учебно-методическое и информационное обеспечение самостоятельной работы	8
6.1 Основная литература	8
6.2 Дополнительная литература	8
6.3 Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»	8

1 Цель самостоятельной работы

Цель организации самостоятельной работы по дисциплине «Управление рисками» – это углубление и расширение теоретических знаний в области управления рисками; формирование практических навыков и развитие интереса к самостоятельной познавательной деятельности; овладение приемами методов анализа и оценки рискованных ситуаций; формирование профессиональных компетенций.

2 Задачи самостоятельной работы

Основными задачами самостоятельной работы обучающихся по дисциплине «Управление рисками» являются:

- ознакомление с основополагающими концепциями риск-менеджмента;
- формирование системы знаний о неопределенности и риске и особенностях их проявления;
- изучение подходов к идентификации, анализу и оценке рисков;
- формирование системы знаний о методах управления рисками и условиях их применения;
- выработка умений и навыков по управлению рисками.

3 Трудоемкость самостоятельной работы

Трудоемкость самостоятельной работы обучающихся по дисциплине «Управление рисками» составляет в очно-заочной форме - 144 ч.

4 Формы самостоятельной работы

По дисциплине «Управление рисками» предусмотрены следующие формы самостоятельной работы: подготовка к практическому занятию.

5 Структура самостоятельной работы

очная-заочная форма обучения

Изучаемая тема	Форма самостоятельной работы	Содержание самостоятельной работы	Трудоемкость, ч
Основные понятия и принципы управления рисками, их классификац	Подготовка к практическому занятию	1. Каким образом разграничиваются понятия «риск» и «неопределенность»? 2. На какие три категории подразделяются риски? Кратко охарактеризуйте каждую. 3. Назовите два типа неопределенности, дайте им краткую характеристику.	40

ия		<p>4. По какой формуле рассчитывается вероятность какого-либо события?</p> <p>5. Дайте определение понятия «степень риска».</p> <p>6. Перечислите основные источники риска.</p> <p>7. В чем заключается разница между категориями «риск» и «опасность»?</p> <p>8. На какие три группы можно разделить факторы рисков бизнеса в реальном секторе экономики?</p> <p>9. Назовите элементы, характеризующие сущность риска.</p> <p>10. Дайте характеристику основных функций риска.</p> <p>11. Дайте определение понятия «управление рисками».</p> <p>12. В чем заключается цель управления рисками?</p> <p>13. Что относится к неизвестным факторам риска?</p> <p>14. Каким образом можно рассчитать риск? Назовите формулу.</p> <p>15. Дайте определение понятия «угроза».</p> <p>16. Перечислите основные функции субъекта управления.</p> <p>17. Что понимается под системой управления рисками?</p> <p>18. Объясните целесообразность создания специального подразделения по управлению рисками.</p> <p>19. В чем заключается основополагающая предпосылка модели линий трех защиты?</p> <p>20. Раскройте сущность ключевых ролей трех «линий» в процессе управления рисками организации.</p> <p>21. Что означает термин «риск-аппетит»?</p> <p>22. Каким образом система управления рисками может снизить чувствительность предприятия к ударам рыночной экономики и минимизировать их финансовые последствия?</p> <p>23. Благодаря чему система управления рисками может повысить конкурентоспособность гостиничного предприятия на рынке?</p> <p>24. На какие группы разделил риски Дж. М. Кейнс?</p> <p>25. В чем заключается особенность чистых и спекулятивных рисков?</p> <p>26. Какие типы предпринимательского риска выделяет Й. Шумпетер?</p> <p>27. Приведите примеры предпринимательского риска.</p> <p>28. Какие риски входят в группу инвестиционных рисков?</p> <p>29. Перечислите основные причины производственного риска.</p> <p>30. Назовите два подвида экономического валютного риска.</p> <p>31. В случае чего наступает риск возникновения непредвиденных расходов?</p> <p>32. Дайте определение понятия «риски внешних лиц».</p> <p>33. На какие подвиды можно разделить риски потери имущества?</p> <p>34. Каковы основные причины страхового риска?</p> <p>35. К какой группе рисков относятся селективные риски?</p> <p>36. В чем различия между финансовыми рисками и</p>	
----	--	--	--

		<p>коммерческими рисками?</p> <p>37. Назовите внешние и внутренние факторы коммерческих рисков.</p> <p>38. Охарактеризуйте риски по масштабу влияния.</p> <p>39. Что представляет собой техногенный риск?</p> <p>40. Перечислите типы рисков по степени допустимости.</p> <p>41. На каких основных принципах основывается управление рисками?</p>	
<p>Этапы, стратегии и методы управления рисками</p>	<p>Подготовка к практическому занятию</p>	<p>42. Назовите основные правила управления рисками.</p> <p>43. Перечислите основные этапы управления рисками.</p> <p>44. Охарактеризуйте этап постановки целей.</p> <p>45. Что представляет собой этап выявления и анализа рисков?</p> <p>46. Назовите абсолютные показатели оценки риска в условиях определенности.</p> <p>47. Перечислите относительные показатели оценки риска.</p> <p>48. Назовите показатели, характеризующие финансовую независимость предприятия.</p> <p>49. Какие группы финансовых коэффициентов используют для оценки финансовых рисков деятельности предприятия?</p> <p>50. Какие методы оценки риска используются в условиях частичной и полной неопределенности?</p> <p>51. Раскройте сущность этапа выбора и реализации методов управления рисками.</p> <p>52. Что понимается под обработкой риска?</p> <p>53. Что такое реестр рисков?</p> <p>54. Раскройте принцип построения карты рисков.</p> <p>55. Дайте характеристику этапа мониторинга и корректировки результатов управления рисками.</p> <p>56. Как осуществляется оценка эффективности управления рисками?</p> <p>57. Перечислите виды стратегий развития предприятия.</p> <p>58. Приведите характеристики стратегий управления рисками.</p> <p>59. Раскройте сущность основных групп методов управления рисками.</p> <p>60. В чем состоят различия юридических и административных методов управления рисками?</p> <p>61. В чем заключается содержательный смысл социально-психологических методов управления рисками?</p> <p>62. Назовите основные виды экономических методов воздействия (управления) на риски.</p> <p>63. Перечислите особенности метода уклонения от рисков. При каких условиях целесообразно применение данного метода?</p> <p>64. Назовите виды контрактов, используемые в условиях применения метода передачи рисков.</p> <p>65. Объясните сущность метода распределения рисков.</p> <p>66. Что понимается под локализацией рисков?</p> <p>67. По каким основным направлениям реализуется диверсификация рисков на предприятии?</p>	<p>40</p>

		<p>68. Какие виды диверсификации вам известны?</p> <p>69. Назовите отличительную особенность метода компенсации рисков.</p> <p>70. В чем выражается сущность страхования как инструмента управления рисками? Какие преимущества от использования метода страхования?</p> <p>71. Что является объектом обязательного страхования?</p> <p>72. Охарактеризуйте цель хеджирования.</p> <p>73. Перечислите три основных вида хеджирования.</p> <p>74. В чем заключаются преимущества и недостатки метода лимитирования рисков?</p> <p>75. Назовите основную проблему, связанную с использованием метода резервирования средств.</p> <p>76. Назовите и сформулируйте критерии выбора решений в условиях риска.</p>	
Идентификация, анализ и оценка рисков	Подготовка к практическому занятию	<p>77. Назовите основные формы управления рисками.</p> <p>78. Перечислите формализованные методы идентификации и оценки рисков.</p> <p>79. Назовите интуитивные методы идентификации и оценки рисков.</p> <p>80. Дайте характеристики исторической и математической аналогии.</p> <p>81. Назовите цель методов экстраполяции.</p> <p>82. В чем состоит метод наименьших квадратов?</p> <p>83. Охарактеризуйте цель сценарного анализа.</p> <p>84. В чем заключается анализ точки безубыточности?</p> <p>85. Какие методы индивидуальных и коллективных экспертных оценок можете назвать?</p> <p>86. Дайте определение понятия «SWOT-анализ».</p> <p>87. При каких обстоятельствах используют карточки Кроуфорда?</p> <p>88. Назовите основные технологии оценки риска в процессе управления рисками.</p> <p>89. С какими проблемами сопряжено использование качественных и количественных оценок риска?</p> <p>90. Какой показатель характеризует вероятность возникновения риска под воздействием определенного фактора риска (или группы таких факторов) и возможных финансовых потерь при наступлении рискового события?</p> <p>91. Какие показатели рассчитывают при использовании экономико-статистических методов оценки?</p> <p>92. Что представляет собой показатель «чистая текущая (приведенная) стоимость»?</p> <p>93. Что понимается под периодом окупаемости?</p> <p>94. В чем достоинство и недостаток модели «подверженной риску стоимости» (Value at Risk)?</p> <p>95. Перечислите источники финансирования рисков</p>	40

6 Учебно-методическое и информационное обеспечение самостоятельной работы

6.1 Основная литература:

- 1) Каранина, Е.В. Управление рисками: механизмы, инструменты, профессиональные стандарты: учебник: [16+] / Е.В. Каранина. – Москва; Берлин: Директ-Медиа, 2020. – 257 с.: ил., табл., схем. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=576521>.
- 2) Черняков, М.К. Управление рисками: конспект лекций: учебное пособие: [16+] / М.К. Черняков, М.М. Чернякова; под ред. М.К. Чернякова; Новосибирский государственный технический университет. – Новосибирск: Новосибирский государственный технический университет, 2018. – 144 с.: ил., табл. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=574663>.

6.2 Дополнительная литература

- 1) Балдин, К.В. Управление рисками: учебное пособие / К.В. Балдин, С.Н. Воробьев. – Москва: Юнити-Дана, 2017. – 511 с.: ил., табл., схем. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=615795>.
- 2) Амирова, З.Б. Управление рисками: методические рекомендации по практическим занятиям: методическое пособие: [16+] / З.Б. Амирова; Московская государственная академия водного транспорта. – Москва: Альтаир: МГАВТ, 2019. – 29 с.: табл. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=682026>.
- 3) Балдин, К.В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия: учебное пособие: [16+] / К.В. Балдин, И.И. Передеряев, Р.С. Голов. – 5-е изд., стер. – Москва: Дашков и К°, 2021. – 418 с.: ил., табл., схем. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=684196>.

6.3 Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

- 1) Электронный каталог научных журналов <http://elibrary.ru/titles.asp>.
- 2) База данных Открытые данные Министерств РФ <https://data.gov.ru>.
- 3) Статистические данные от Росстата России <https://rosstat.gov.ru/opendata>.
- 4) Информационно-справочная система «КонсультантПлюс» - <http://www.consultant.ru/>.