

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«Воронежский государственный технический университет»

Кафедра конструирования и производства радиоаппаратуры

МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ

к выполнению курсовой работ по дисциплине

«Менеджмент рисков»

для студентов направления 38.03.02 «Менеджмент»

(профиль «Менеджмент организации»)

всех форм обучения

Воронеж 2020

УДК 005я73

ББК 65я73

Составители:

к.т.н. Е.А.Сидорова,

Методические указания к выполнению курсовой работы по дисциплине «Менеджмент рисков» предназначены для студентов направления 38.03.02 «Менеджмент», всех форм обучения с целью изучения студентами основных концепций риск-менеджмента и умения выявлять проблемы при анализе рискованных ситуаций, предлагать способы их решения и разработку мероприятий по снижению негативного влияния факторов риска и неопределенности / ФГБОУ ВО «Воронежский государственный технический университет»; сост.: Е.А. Сидорова. Воронеж: Изд-во ВГТУ, 2020. 38 с.

Методические указания подготовлены в электронном виде и содержатся в файле LR4 FOPI.pdf.

Ил. 3. Табл. 46. Библиогр.: 7 назв.

УДК 005я73

ББК 65я73

Рецензент – С.С.Уварова, д.э.н. проф. кафедры цифровой и отраслевой экономики ВГТУ

Издается по решению редакционно-издательского совета Воронежского государственного технического университета

МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ

к выполнению курсовой работ по дисциплине

«Менеджмент рисков»

для студентов направления 38.03.02 «Менеджмент»

(профиль «Менеджмент организации»)

всех форм обучения

Составители:

Сидорова Екатерина Александровна

Компьютерный набор Е.А. Сидорова

Подписано к изданию _____.

Уч.-изд. л. _____.

ФГБОУ ВО «Воронежский государственный технический университет» 394026 Воронеж, Московский просп, 14

Оглавление

ВВЕДЕНИЕ.....	5
1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ КУРСОВОЙ РАБОТЫ.....	5
2. ОБЩИЕ ТРЕБОВАНИЯ К ВЫПОЛНЕНИЮ КУРСОВОЙ РАБОТЫ.....	5
2.1 Выбор темы курсовой работы	5
2.2 Подготовка к написанию курсовой работы.....	6
2.3. Структура курсовой работы.....	6
2.4. Оформление курсовой работы.....	6
3. ОСНОВНАЯ ЧАСТЬ КУРСОВОЙ РАБОТЫ	7
ЗАКЛЮЧЕНИЕ	20
СПИСОК ЛИТЕРАТУРЫ	21
ПРИЛОЖЕНИЕ А.....	22
ПРИЛОЖЕНИЕ Б.....	23

ВВЕДЕНИЕ

Каждый человек постоянно имеет дело с различного вида рисками, в том числе в своей производственной деятельности. Любой специалист предпочитает просчитать свои риски и шансы, предусмотреть возможные угрозы и попытаться снизить негативные отклонения. Эти задачи решаются при создании системы управления рисками при управлении процессами.

Необходимость изучения данной дисциплины и разработки курсовой работы заключается в том, что риски являются необходимой сопутствующей составляющей любого бизнеса, т.к. реальная ситуация практически никогда полностью не соответствует запланированным или желаемым параметрам. Грамотно выполненный анализ и оценка рисков позволяет предприятию выявить сферы повышенного риска, а руководителю вовремя принять своевременные решения по снижению влияния негативных последствий.

1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ КУРСОВОЙ РАБОТЫ

Цель курсовой работы - научить студентов применять методы управления рисками. Риск обязательно должен быть рассчитан до максимально допустимого предела. Как известно, все оценки носят многовариантный характер. Необходимо постоянно корректировать систему действий с позиций минимизации риска.

В соответствии с поставленными целями студент в процессе выполнения курсовой работы должен решить следующие задачи:

- изучить методологические основы принятия риск-решений;
- уметь применить методы управления риском;
- знать и уметь применять принципы управления различными видами рисков;
- осуществлять информационно-аналитическую деятельность: сбор, обработка и анализ информации о факторах внешней и внутренней среды организации для принятия управленческих решений;
- приобрести практические знания и навыки по обоснованию и оценке рисков и предупредительных управленческих мер.

2. ОБЩИЕ ТРЕБОВАНИЯ К ВЫПОЛНЕНИЮ КУРСОВОЙ РАБОТЫ

2.1 Выбор темы курсовой работы

Знакомство студента с содержанием курса «Менеджмент рисков» позволяет ему сознательно выбрать наиболее интересную для него тему курсовой работы. Выбор может быть произведён из числа рекомендуемых в списке тем курсовых работ. Студент сам может выбрать тему, отсутствующую в списке, но относящуюся к проблемным вопросам дисциплины, предварительно согласовав её с руководителем курсовой работы. Выбранную тему курсовой работы студент закрепляет за собой, сообщив её название руководителю.

2.2 Подготовка к написанию курсовой работы

Написание курсовой работы предполагает изучение литературных источников и подбор иллюстративного материала. В первую очередь целесообразно обращаться к учебным пособиям, которые в системном порядке излагают основное содержание курса. Особое внимание следует уделить изучению содержания основополагающих теоретических и практических вопросов организационного поведения. При изучении монографий, журнальных статей, другой специальной литературы по вопросам, непосредственно относящихся к теме курсовой работы, необходимо составить конспект, излагая содержание своими словами. Такой подход позволит обеспечить правильное понимание изученного материала, а также даст возможность самостоятельно изложить содержание курсовой работы. В качестве иллюстративного материала следует подобрать заполненные аналитические таблицы, графики, схемы, алгоритмы решения задач, рисунки, схемы взаимосвязи показателей и прочее.

2.3. Структура курсовой работы

Курсовая работа □ самостоятельная творческая работа студента, обязательным содержанием которой является:

- ТИТУЛЬНЫЙ ЛИСТ (прил. А);
- СОДЕРЖАНИЕ (прил. Б);
- ВВЕДЕНИЕ (с обоснованием актуальности темы, цели, задач и предполагаемых результатов курсовой работы);
- ГЛАВА 1. Теоретические и методические основы изучения выбранной темы;
- ГЛАВА 2. Построение интегральной оценки риска с программой по формированию снижения риска до минимального уровня.
- ЗАКЛЮЧЕНИЕ ;
- БИБЛИОГРАФИЧЕСКИЙ СПИСОК (не старше 10 лет);
- ПРИЛОЖЕНИЯ (таблицы, графики, тесты, копии документов) с необходимыми ссылками на них по тексту.

2.4. Оформление курсовой работы

Оформление текста работы должно производиться по общим правилам ГОСТ 7.32-2001 «Отчет о научно-исследовательской работе. Структура и правила оформления».

Объем курсовой работы составляет 40-50 страниц печатного текста, в том числе: введение 2-3 страницы, основная часть (1 и 2 главы) – 35-45 страниц, заключение 2-3 страницы. Шрифт - 14 пт, Times New Roman, через 1,5 интервала. Заголовки разделов и подразделов – полужирный шрифт. Поля: левое – 3см, правое – 1см, верхнее и нижнее – по 2см. Курсовая работа выполняется на писчей бумаге стандартного формата. Все схемы, рисунки, таблицы, диаграммы, графики должны иметь название и порядковый номер. На

каждую иллюстрацию необходима ссылка в тексте до её изображения. Нумерация страниц – начиная с Введения.

Ссылки на источники литературы оформляются указанием в квадратных скобках номера источника литературы, приведенного в списке литературы, например: [5, с.10-12]. Это означает, что при изложении материала использованы идеи, мысли, информация из источника, представленного под номером «5» в СПИСКЕ ЛИТЕРАТУРЫ. Цифры «10-12» конкретизируют страницы, на которых размещалась полезная информация в использованном источнике.

3. ОСНОВНАЯ ЧАСТЬ КУРСОВОЙ РАБОТЫ

3.1 Теоретические темы курсовых работ

1 Риск в экономической и предпринимательской деятельности.

Цель: изучение ситуации неопределенности и риска в предпринимательстве.

Задачи:

- раскрыть понятие риска .
- раскрыть понятие неопределённости .
- раскрыть сущность неопределённости и риска в России.
- риски и виды рисков в экономической и предпринимательской деятельности.
- рассмотреть методы оценки предпринимательских рисков
- совершенствование технологии управления риском с помощью создания программы целевых мероприятий по управлению

2 Анализ рисков организации. Источники информации о рисках.

Цель: исследование теоретических основ управления рисками и разработка предложений по минимизации рисков предприятия в современных условиях хозяйствования.

Задачи:

- рассмотреть теоретические аспекты анализа рисков;
- исследовать методы оценки предпринимательских рисков;
- проанализировать источники информации;
- выявить и оценить риски деятельности предприятия (на примере ООО «NNN»);
- разработать рекомендации по управлению рисками

3 Методы идентификации рисков. Картографирование рисков организации.

Цель: систематичное представление опасностей, с которыми предприятие сталкивается в результате проведения каких-либо действий, а также воздействия внешнего окружения и финансовые отношения.

Задачи:

- выявить и идентифицировать основные угрозы текущей и перспективной деятельности
- сформировать состав внешних и внутренних факторов, способных оказать влияние на уровень рисков
- сведение в единую таблицу, представляющую собой систему факторов риска с их перечнем, иногда именуемым профилем факторов риска
- измерение риска в рамках идентификации факторов и первичной оценки инструментально производится сначала качественно, а затем количественно
- при работе с факторами, нужно описать их на уровне: вероятно – не вероятно, опасно – не опасно и насколько опасно (на этой основе можно осуществить построение карты с осями абсцисс, по которой выстроена шкала опасности, и ординат, с размещением на ней шкалы вероятности риска) .

4 Методы оценки рисков. Статистические методы оценки рисков: сравнительный анализ и условия применения.

Цель: изучение видов анализа рисков, методов количественной оценки рисков, сущности статистических методов анализа рисков и их показателей.

Задачи:

- Изучить количественную оценку рисков
- изучение статистики потерь и прибылей,
- научиться определять вероятности события и устанавливать величину риска
- научиться определять колеблемость (вычисляют такие статистические величины, как дисперсия и среднее квадратическое отклонение).

5 Методы оценки рисков. Аналитические методы оценки рисков. Развитие аналитических методов оценки рисков в практике риск-менеджмента.

Цель: изучение оценки чувствительности проекта к изменениям других параметров и оценку финансовой устойчивости предприятия.

Задачи:

- рассмотреть анализ чувствительности, метод корректировки нормы дисконта с учетом риска, метод эквивалентов, метод сценариев, метод аналогов
- выявить их достоинства и недостатки

6 Экспертные методы оценки рисков. Получение индивидуальных и коллективных экспертных оценок: достоинства и недостатки применяемых методов.

Цель: получать информацию от специалистов-экспертов, проводить ее анализ и обобщать результаты для выбора рациональных решений.

Задачи:

- рассмотреть коллективные методы оценивания («мозговая атака», деловые игры, сценарии, совещания, «суд») - предполагают выработку общего мнения в ходе совместного обсуждения;
- рассмотреть методы получения индивидуального мнения (анкетный опрос, метод «Дельфи», интервью)
- выявить их достоинства и недостатки экспертных методов оценки рисков.

7 Предпринимательские риски: сущность, понятие, методы оценки и управления.

Цель: ознакомление с понятием предпринимательских и финансовый риск, подробно изучить классификацию рисков, чтобы снизить их уровень, что позволит получить высокий конечный результат.

Задачи:

- раскрыть сущность и функции предпринимательских рисков;
- произвести классификацию предпринимательских рисков и определить модели построения производственной структуры предприятия
- указать виды и проанализировать подходы к совершенствованию производственной структуры предприятия

8 Методы управления финансовыми рисками. Исследование факторов, влияющих на уровень финансовых рисков организации. Выбор механизмов нейтрализации финансовых рисков.

Цель: проанализировать методы управления финансовыми рисками при реализации инвестиционных проектов.

Задачи:

- рассмотреть сущность и классификацию финансовых рисков предприятия, ознакомиться с их функциями;
- охарактеризовать методы управления финансовыми рисками;
- выявить способы снижения финансовых рисков.

9 Кредитные риски. Роль доллара в современных международных валютных и кредитных отношениях.

Цель: проанализировать и определить виды рисков, выявить проблемы управления рисками, связанные с профессиональной банковской и российской

общегосударственной спецификой. Выявить методы совершенствования мероприятий по снижению кредитного риска

Задачи:

- проанализировать теорию банковских рисков;
- определить виды рисков и их методы управления;
- изучить систему банковского кредитного риска, применение методов управления банковским кредитным риском и российской общегосударственной спецификой;
- выявить принципы процесса управления кредитными рисками в Сбербанке России;
- изучить, основные методы и управления кредитными рисками в Сбербанке России;
- выявить методы совершенствования мероприятий по снижению кредитного риска на примере Сбербанка России

10 Валютные риски. Мировой валютный рынок: современное состояние и перспективы развития. Мировая долларизация и ее место в глобализации.

Цель: изучение природы валютного риска, причины его возникновения, изучение особенностей влияния валютного риска на деятельность отечественных экономических субъектов

Задачи:

- исследовать понятия валютного риска
- рассмотреть классификацию валютных рисков;
- изучить способы снижения степени риска;
- исследовать существующие возможности страхования валютного риска;
- проанализировать особенности современного валютного рынка и осуществляемых на нем операций, а также природу валютного риска в условиях современного финансового рынка.

11 Процентные риски. Влияние учетной ставки процента на экономическую активность. Процентные риски в системе банковских рисков.

Цель: определение сущности процентного риска, его положения относительно других рисков и основных методов борьбы с ним.

Задачи:

- дать понятие процентного риска и определить его место в системе рисков.
- определить теоретические основы использования различных методик оценки процентного риска в коммерческом банке.
- рассмотреть существующие методики оценки и управления процентным риском.
- использовать одну из методик на примере.

12 Операционные риски: идентификация и оценка. Выбор критерия управления операционными рисками.

Цель: подробный анализ методики управления операционными рисками на современном этапе.

Задачи:

- определить сущность управления операционными рисками;
- рассмотреть и проанализировать современные тенденции управления операционными рисками в банковской деятельности;
- на примере конкретной деятельности банка рассмотреть управление операционными рисками

13 Рыночные риски. Методы оценки и инструменты регулирования.

Цель: изучение возможных рыночных рисков и управление рыночными рисками

Задачи:

- изучение понятия рыночных рисков
- изучение способов оценки рыночных рисков
- изучение способа расчета процентного риска
- изучение способа расчета фондового риска
- изучение способа расчета валютного риска на основе метода Value-at-Risk (VaR)

14 Риски ликвидности. Анализ денежных потоков организации как метод управления рисками ликвидности. Пути повышения ликвидности и платежеспособности организации.

Цель: разобраться с основными понятиями и принципами анализа ликвидности организации, наглядно показать необходимость проведения такого анализа и использования его результатов для повышения эффективности принимаемых решений по управлению финансовыми ресурсами .

Задачи:

- изучение влияния факторов, определяющих уровень ликвидности организации, и возможностей более гибкого управления ликвидностью, а значит - более эффективного управления финансами.
- рассмотреть существующие в мировой практике теории и методы управления ликвидностью, возможности применения их элементов при проведении практического анализа внутри организации.

15 Риски развития. Лидерство в снижении издержек и дифференциация. Поиск наиболее эффективного пути развития.

Цель: анализ способов интеграции и способов эффективного пути развития

Задачи:

- изучить возможности расширения рынков сбыта, стремление к уменьшению рисков развития бизнеса, замена конкуренции на кооперацию и сотрудничество
- изучение межфирменной международной интеграции, стратегическим альянсам и совместным предприятиям.
- анализ результатов интеграции (обмен технологиями и наиболее полное использование результатов НТП, более глубокая специализация и производственная кооперация, способствующие дальнейшему снижению затрат в производстве).

16 Инвестиционные риски. Оценка и управление рисками инвестиционного проекта.

Цель: оценка рисков инвестиционного проекта (на примере организации) и формирование рекомендаций по управлению рисками инвестиционной деятельности

Задачи:

- рассмотреть понятие и виды рисков инвестиционных проектов;
- определить основные источники информации для оценки рисков;
- изучить основные методы оценки рисков инвестиционных проектов;
- дать общую характеристику инвестиционного проекта (на примере организации);
- провести оценку риска инвестиционного проекта (на примере организации) методом экспертных оценок.

17 Инвестиционные риски. Формирование инвестиционного портфеля с учетом риска.

Цель: изучение теоретических и практических основ управления рисками инвестиционных проектов.

Задачи:

- раскрытие сущности рисков инвестиционных проектов и методов их оценки
- выявление различных методов управления рисками инвестиционных проектов
- анализ деятельности компании и инвестиционного проекта, инициатором которой она является
- оценка эффективности инвестиционного проекта
- изучение практических методов оценки и управления рисками в ходе реализации инвестиционного проекта
- разработка рекомендаций по совершенствованию системы управления в компании

18 Стратегические риски. Стратегическая безопасность. Проблемы и перспективы глобализации.

Цель: изучение методов стратегического анализа рисков предприятия

Задачи:

- описание методологических основ риск-менеджмента.
- рассмотрение современного стратегического анализа рисков.
- разработка предложений по стратегическому анализу рисков предприятия

19 Страновые риски. Мировой экономический кризис и тенденции развития российской экономики.

Цель: рассмотрение страновых рисков прямых иностранных инвестиций, а так же оценка страновых рисков.

Задачи:

- изучение причин появления страновых рисков
- возможные пути защиты от страновых рисков
- анализ страновых рисков на примере стран

20 Политический риск: сущность, уровни. Управление политическими рисками

Цель: изучить уровень влияния политических факторов в стране (регионе), которые могут оказать благоприятное или отрицательное влияние на управленческую, экономическую и другие виды деятельности

Задачи:

- определить вероятность возникновения благоприятных и отрицательных политических факторов в стране (регионе)
- вероятность неблагоприятных последствий политических решений, принимаемых в условиях неопределенности, дефицита ресурсов (времени, информации и т.д.), что ведет к ущербу для участников политических действий и вероятности осуществления нежелательных событий

21 Анализ техногенных и экологических рисков

Цель: исследование рискообразующих факторов в Воронежской области.

Задачи:

- исследование техногенных систем и природной среды Воронежской области.
- выявить основные источники техногенных нагрузок в Воронежской области,
- проанализировать техногенные и природные опасности в Воронежской области.

22 Принятие решений в условиях неопределенности и риска.

Цель: научиться принимать решения в условиях неопределенности, когда у руководителя отсутствует возможность оценить вероятность будущих результатов.

Задачи:

- научиться принимать решения в условиях риска, когда не определены результаты их реализации, но вероятность наступления каждого из них известна.
- Научиться принимать решения в условиях неопределенности, когда у руководителя отсутствует возможность оценить вероятность будущих результатов.
- научиться принимать решения в условиях определенности, если руководитель точно знает результат реализации каждой альтернативы.

23 Организация системы риск-менеджмента предприятия.

Цель: исследование организации риск-менеджмента предприятия и системы минимизации риска, предвидеть ее возможности и перспективы, а так же разработка своевременного и оперативного совершенствования по управлению рисками.

Задачи:

- исследовать теоретические аспекты риск-менеджмента;
- определить сущность и разнообразие рисков, способы их оценки, особенности управления рисками.
- выявить основные закономерности и проблемы;
- изучить систему способов минимизации рисков и выявить методы по их совершенствованию;
- провести анализ и дать оценку рискам предприятия на основе показателей финансовой отчетности и предложить мероприятия для совершенствования их минимизации;

24 Основы банковского риск-менеджмента.

Цель: разработка и углубленное изучение теоретико-методологических основ формирования и совершенствования риск-менеджмента на основе нормативно-правовых актов, научной и периодической литературы, статистической информации.

Задачи:

- определению понятия риск-менеджмента, типичных банковских рисков, политики управления ими;
- приведению способов расчёта и оценки основных видов риска;
- обосновано объективной необходимости формирования риск-менеджмента;

- определению значимости риск-менеджмента для России и перспектив его развития;
- изучению нормативно-правовой документации, теоретической и периодической литературы, рассматривающей риск-менеджмент банков, статистических материалов, включающих данные об объёмах рисков;
- анализу собранных данных при использовании статистических методов обработки и анализа информации;
- иллюстрированию схемами, таблицами представленного материала;
- формулированию выводов и предложений по организации риск-менеджмента в банке.

25 Риск-менеджмент в страховом деле.

Цель: является анализ положения страховой организации в условиях неопределенности.

Задачи:

- анализ показателей, характеризующих положение страховой организации;
- идентификация рисков, оказывающих негативное влияние на деятельность страховой организации;
- анализ методов управления рисками.

26 Методы управления риском. Общая схема процесса управления риском. Выбор методов управления риском на основе оценки их сравнительной эффективности.

Цель: раскрытия содержания методов управления рисками предприятия и в разработке механизма эффективного управления рисками предприятия в современных условиях хозяйствования..

Задачи:

- рассмотреть понятие риска;
- изучить классификацию и виды рисков;
- охарактеризовать методы оценки риска;
- проанализировать методы организации управления рисками на предприятии;
- подвергнуть анализу оценку риска предприятия на основе показателей финансовой отчетности;
- подвергнуть рассмотрению анализ рисков предприятия и методов, используемых для минимизации риска;
- разработать конкретные мероприятия по совершенствованию системы управления риском на предприятии.

27 Методы управления риском: хеджирование.

Цель: изучение методов управления риском хеджирования.

Задачи:

- рассмотреть теоретические и методические подходы к анализу финансовых и валютных рисков и способы управления ими;
- ознакомиться с сущностью и понятием хеджирования; изучить виды и методы хеджирования;
- рассмотреть выгоды хеджирования и его недостатки.

28 Методы управления риском: лимитирование.

Цель: изучить лимитирование как способ снижения рисков.

Задачи:

- изучить суть метода управления финансовыми рисками лимитирование: установлении максимального размера средств, которые могут быть потрачены на выполнение определенных операций; введение ограничений при выполнении других операций; установлении максимального размера заемных средств, максимальный размер депозита в одном банке и т.п.
- разработать специальные внутренние правила и инструкции, устанавливающие предельно допустимый уровень риска по каждому направлению деятельности организации.
- распределение функций и ответственности между сотрудниками организации
- ответить на вопрос - всегда лимитирование является эффективным методом управления финансовыми рисками?

29 Методы управления риском: страхование, самострахование.

Цель: изучить страхование рисков предприятия как метод снижения неопределенности в планировании финансовой деятельности

Задачи:

- изучение работы и структуры страховых фондов
- уметь рассчитывать и знать от чего зависят страховые тарифы
- ответить на вопрос: страхование может обеспечить полную компенсацию всех убытков?
- изучить особенности при страховании уникальных объектов
- рассмотреть самострахование как внутренний резервный фонд.
- ответить на вопрос: что выгоднее страхование или самострахование?

30 Методы управления риском: диверсификация. Анализ существующих подходов к размещению капитала по направлениям деятельности.

Цель: рассмотреть теоретические основы диверсификации, а также применение метода диверсификации на примере организации.

Задачи:

- раскрыть классификацию предпринимательских рисков;
- виды и цели диверсификации;

- рассмотреть диверсификацию в системе методов снижения рисков предприятия;
- рассмотреть диверсификацию инвестиционного портфеля.
- на примере организации предложить направления диверсификации для снижения предпринимательских рисков.

31 Диагностика финансового кризиса предприятия. Анализ рисков при угрозе банкротства.

Цель: разработка методологических положений и практических рекомендаций по диагностике кризисного процесса на различных его стадиях в рамках антикризисного управления организацией

Задачи:

- изучение теоретических аспектов диагностики кризисов в процессах управления;
- рассмотреть особенности диагностики кризиса на предприятии;
- рассмотрение общих понятий и типологии кризисов
- изучить критерии, признаки, а также принципы несостоятельности;
- выявить особенности правовой регламентации отдельных процедур банкротства

32 Методы нейтрализации рисков. Рынок форвардов в России. Хеджирование на основе инструментов FORTS.

Цель: изучение теоретических основ: сущности, содержания и видов финансовых рисков, а также принципов управления и механизмов нейтрализации финансовых рисков

Задачи:

- раскрыть экономическую сущность финансовых рисков и классифицировать по основным признакам;
- рассмотреть систему управления финансовыми рисками на основе принципов, методов, факторов, влияющих на уровень финансовых рисков;
- представить основное содержание политики управления финансовыми рисками;
- определить различные способы и методы нейтрализации рисков;
- изучение рынка FORTS, как основной торговой площадкой производными финансовыми инструментами

33 Риски в глобальной экономике: основные подходы к управлению.

Цель: проанализировать глобальные проблемы экономики, их взаимосвязь с проблемами стоящими перед человечеством.

Задачи:

- проанализировать основные глобальные проблемы, стоящие перед человечеством;

- изучить глобальные проблемы Мировой экономики;
- предположить направление развития проблемных ситуаций и наиболее оптимальные пути выхода из них
- антикризисные действия различных стран Мира
- развитие кризиса в России
- итоги минувших этапов экономического кризиса

34 Риски мировой валютной системы. Перспективы кризиса.

Цель: изучение природы валютного риска, причины его возникновения, кто подвержен риску

Задачи:

- выявить способов управления валютными рисками;
- провести оценку валютного риска на примере банка;
- способы снижения валютного риска;
- определить способы страхования валютных рисков
- выявить способов управления валютными рисками;
- провести оценку валютного риска на примере банка;
- способы снижения валютного риска;
- определить способы страхования валютных рисков.

35 Использование рискостойимости (VaR) для анализа рисков

Цель: изучение природы валютного риска, исследование теоретических аспектов применения VaR-анализа, рассмотреть основные методы и подходы к расчету показателя VaR, также провести расчет показателя VaR для валютного портфеля, причем рассчитан как агрегированный VaR, так и VaR для отдельных активов.

Задачи:

- исследование понятия валютного риска и его разновидностей;
- изучение и классификация методов VaR-оценки валютных рисков банковских портфелей
- описание конкретной методики VaR-анализа, по которой проводились расчеты,
- вычисление показателя VaR и анализ полученных результатов

36 Использование метода статистических испытаний (Monte-Carlo Simulation) в системе управления рисками

Цель: изучении метода имитационного моделирования Монте-Карло и получении практических навыков по применению данного метода для принятия управленческих решений

Задачи:

- рассмотреть общие принципы метода Монте-Карло
- применить метод Монте-Карло применительно к риск-менеджменту.

- проанализировать влияние факторов риска — выбранных параметров проекта — на изучаемые показатели его оценки с помощью метода Monte-Carlo
- попробовать смоделировать по методу Монте-Карло автоматизированную математическую методику, предназначенную для учета риска в процессе количественного анализа и принятия решений.

ЗАКЛЮЧЕНИЕ

В последние годы во всех развивающихся странах с развитой экономикой особое внимание обращается на обеспечение подготовки специалистов в области анализа риска и управления риском и безопасностью. Опыт образования в этой сфере дает основание утверждать, что целесообразно развивать направление подготовки специалистов, непосредственно занимающихся исследованием риска, которые должны уметь идентифицировать опасности, оценивать конкретные риски, анализировать конкретные результаты, моделировать и прогнозировать развитие опасных ситуаций, на основании чего выработать рекомендации по эффективным мерам управления риском для лиц, ответственных за принятие решений.

СПИСОК ЛИТЕРАТУРЫ

1. Антонов, Г.Д. Управление рисками организации: Учебное пособие / Г.Д. Антонов, В.М. Тумин, О.П. Иванова. - М.: Инфра-М, 2019. - 464 с.
2. Бадалова, А.Г. Управление рисками деятельности предприятия: Учебное пособие / А.Г. Бадалова, А.В. Пантелеев. - М.: Вузовская книга, 2016. - 234 с.
3. Баркалов, Сергей Алексеевич, Киреева, Екатерина Александровна, Семенов, Петр Иванович Управление рисками: учеб.-метод. комплекс. - Воронеж : Научная книга, 2012 -479 с.
4. Васин, С.М. Управление рисками на предприятии: Учебное пособие / С.М. Васин, В.С. Шутов. - М.: КноРус, 2018. - 352 с.
5. Рыхтикова, Н.А. Анализ и управление рисками организации: Учебное пособие / Н.А. Рыхтикова. - М.: Инфра-М, 2015. - 128 с.
6. Бизнес-планирование: учеб.- метод. комплекс / составители: С.А. Баркалов, О.Н. Бекирова, М.Л. Бурлаков; Нижегородский государственный технический университет им. Р.Е. Алексеева. – Н.Новгород, 2010. – 252с.
7. Модели управления конфликтами и рисками [Текст]: монография/С.А.Баркалов [и др.]; под ред. Д.А.Новикова. – Воронеж: Научная книга, 2008.-495с.

ПРИЛОЖЕНИЕ А

Образец оформления титульного листа курсовой работы

**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«Воронежский государственный технический университет»

Факультет экономики, менеджмента и информационных технологий

Кафедра управления

КУРСОВАЯ РАБОТА

по дисциплине: «Менеджмент рисков»

на тему: «_____»

Выполнил:

студент группы _____

_____ ФИО

(подпись студента)

Руководитель:

_____ (должность):

_____ ФИО

« _____ » _____ 20 _____ г

(подпись преподавателя)

Воронеж 20 _____

ПРИЛОЖЕНИЕ Б

Образец оформления содержания работы

Содержание	
ВВЕДЕНИЕ	
1 Наименование первой главы (Теоретическая часть курсовой работы).....	
1.1.Название первого подраздела	
1.2.Название второго подраздела	
1.3.	
1.4. Выводы по первому разделу.....	
2 Наименование второй главы (Интегральная оценка риска)	
2.1. Решение задачи по снижению вероятности с минимальными затратами ..	
2.2. Определение минимальной величины затрат, требуемых для снижения величин ущерба до минимального или среднего уровня степени опасности ...	
2.3. Построение системы комплексного оценивания для определения интегральной оценки риска	
2.4. Формирования программы снижения риска до среднего и минимального уровня степени опасности	
2.5. Результаты расчета комплексного оценивания.....	
ЗАКЛЮЧЕНИЕ	
БИБЛИОГРАФИЧЕСКИЙ СПИСОК	
ПРИЛОЖЕНИЯ.....	

МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ
к выполнению курсовой работ по дисциплине

«Менеджмент рисков»

для студентов направления 38.03.02 «Менеджмент»
(профиль «Менеджмент организации»)
всех форм обучения

ДЛЯ СТУДЕНТОВ, ОСВАИВАЮЩИХ ОСНОВНЫЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ
ПРОГРАММЫ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ – ПРОГРАММЫ БАКАЛАВРИАТА,

СОСТАВИТЕЛИ:

Сидорова Екатерина Александровна

Подписано к изданию 22.01.2020 г.

Объем 54 КБ.

ФГБОУ ВО «Воронежский государственный технический университет» 394026
Воронеж, Московский проспект, 14