Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Минцаев Магомед Шавалович
Должность: Ректор
Дата подписания: 19.10.2023 10:48:21
Уникальный программный ключ:
236bcc35c296f119d6aafdc22836b21db52dbc07971a86865a5825f9fa4304cc

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ

имени академика М.Д. Миллионщикова

УТВЕРЖДАЮ
Первый проректор
И.Г. Гайрабеков
_____
«01» 09 20 20 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины

«Экономические риски деятельности предприятий»

Направление подготовки

38.03.01 Экономика»

Профиль

«Экономика предприятий и организаций
(в нефтяной и газовой промышленности)»

Квалификация

Бакалавр

Грозный – 2020

1. Цели и задачи дисциплины

Цель дисциплины «Экономические риски деятельности предприятий» состоит в получении студентами теоретических и практических навыков в области оценки и управления экономическими рисками на предприятии.

Задачи изучения дисциплины:

- изучить особенности построения системы управления рисками в энергетической сфере;
- формирование у студентов научно обоснованные представления о системе организации деятельности предприятия, механизмах управления деятельностью, как в обычных, так и экстремальных (кризисных) условиях,
- изучить основные методы оценки и управления экономическими рисками,
- получение навыков управления рисками.

2. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Экономические риски деятельности предприятий» входит в часть дисциплин по выбору. Изучается в 8 семестре 4 курса. Содержание дисциплины тесно связано с содержанием других экономических дисциплин, изучаемых в университете. Для ее изучения студент должен обладать системными входными знаниями по дисциплинам «Экономика промышленного производства», «Налогообложение организаций», «Управление конкурентоспособностью предприятия», «Экономическая оценка инвестиций».

Усвоение студентами содержания дисциплины «Экономические риски деятельности предприятий» позволит им эффективно использовать полученные знания для написания выпускной квалификационной работы.

3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины (модуля).

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

а) общепрофессиональные (ОПК):

- способность осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач (ОПК-2);

б) профессиональные (ПК):

- способность критически оценивать предлагаемые варианты управленческих решений, разрабатывать и обосновывать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий (ПК-11).

В результате освоения дисциплины студент должен:

Знать:

- методологические основы управления рисками;
- основные виды экономических рисков;
- способы и методы оценки рисков на производственном предприятии;
- основные инструменты и методы управления рисками.

Уметь:

- формировать информацию для анализа по данным финансовой отчетности;
- идентифицировать риски:
- проводить качественный и количественный анализ рисков на производственном предприятии.

Владеть:

- навыками применения методов управления экономическими рисками;
- методикой оценки экономических рисков.

4.Объем дисциплины и виды учебной работы

Таблица 1

Вид учебной работы		Всего часов/з.е.		Семестры	
				ОФО	ЗФО
		ОФО	ЗФО	8	6
Контактная работа (всего)		**48/1,3**	**16/0,4**	**48**	**16**
В том числе:					
Лекции (Л)		24/0,67	8/0,2	24	8
Практические занятия (ПЗ)		24/0,67	8/0,2	24	8
Семинары (С)		-	-	-	-
Лабораторные работы (ЛР)		-	-	-	-
Самостоятельная работа(всего)		**96/2,67**	**128 /3,6**	**96**	**128**
В том числе:					
Курсовая работа (КР)		-	-	-	-
Расчетно-графические работы (РГР)		-	-	-	-
И(или) другие виды самостоятельной работы:		**96/2,67**	**128/3,6**	96	128
Темы для самостоятельного изучения		18/0,5	84/2,3	18	84
Подготовка к практическим занятиям (ПЗ)		36/1	24/0,67	36	24
Подготовка к зачету		42/1,17	36/1	42	36
Вид отчетности		зачет	зачет	зачет	зачет
Общая трудоемкость дисциплины	**ВСЕГО в часах**	**144**	**144**	**144**	**144**
	ВСЕГО в зач. единицах	**4**	**4**	**4**	**4**

5.Содержание дисциплины

5.1. Разделы дисциплины и виды занятий

Таблица 2

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	ОФО		
		6семестр		
		Лекции (час)	Практ. занятия (час)	Всего (час)
1	Теоретические основы менеджмента риска	8	8	16
2	Менеджмент предпринимательских рисков	4	4	8
3	Стандарты менеджмента риска	4	4	8
4	Управление финансовыми и нефинансовыми рисками	8	8	16
	Итого:	24	24	48

5.2 Лекционные занятия

Таблица 3

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела
1	Неопределенность и риск	Понятие и области проявления неопределённости. Признаки классификации неопределенностей. Типы (виды) неопределенности при принятии решения. Источники неопределенности. Взаимосвязь категорий «неопределенность» - «риск» - «потеря». Отличительные особенности понятий «неопределенность» и «риск».
2	Теория риска: функции и характерные черты риска	Классическая теория риска, неоклассическая теория риска и кейнсианская теория риска. Теория риска в советской экономической науке. Подходы современных экономических теорий в определении «риска». Основные факторы неопределенности, препятствующие хозяйственной и инвестиционной деятельности в России. Три подхода экономических теорий в определении понятия «риск». Функции риска. Характерные черты риска
3	Принципы менеджмента риска. Классификация рисков	Формирование системы принципов управления рисками. Основополагающие принципы управления рисками, которым надлежит следовать субъекту управления. Принципы, предлагаемые Международным стандартом ISO 31000:2009. Классификация рисков по времени возникновения. Классификации рисков по факторам возникновения. Классификация рисков по характеру последствий (экономического результата). **К**лассификация рисков по сфере возникновения. Классификация рисков по уровню последствия
4	Система риск-менеджмента. Процесс менеджмента риска	Понятие и содержание системы риск-менеджмента. Задачи системы менеджмента риска. Объект риск-менеджмента. Система лимитов на риск. Режимы функционирования системы риск-менеджмента . Этапы процесса менеджмента риска. Этапы процесса управления рисками, предложенные западными исследователями. Процесс менеджмента риска согласно Международному стандарту ISO 31000:2009. Стадии процесса управления риском
5	Методы управления рисками	Дособытийные методы управления рисками. Послесобытийные методы управления рисками. Организационные методы управления рисками. Методы уклонения от рисков. Методы локализации рисков. Методы диверсификации рисков. Методы компенсации риска**.** Методы контроля процесса выполнения планируемой программы мероприятий по снижению риска от реализации стратегии функционирования предприятия
6	Анализ рисков	Анализ рисков: содержание и общие принципы. Концепции анализа рисков, различающихся по исследуемым сферам его проявления. Анализ рисков на стратегическом, тактическом и оперативном уровнях. Блок-схема анализа риска. Концепция качественного анализа рисков. Количественный анализ рисков. Концепция количественного анализа рисков. Методы количественного анализа рисков. Качественные измерители риска

7	Менеджмент предпринимательских рисков: понятие, сущность и содержание.	Понятие предпринимательский риск. Сущность предпринимательского риска. Внутренние риски. Внешним рискам. Краткосрочные риски. Постоянные риски. Производственный риск. Коммерческий риск. Финансовый риск
8	Факторы макро- и микросреды предпринимательства. Классификация предпринимательских рисков	Микросреда предпринимательства: факторы. Конкуренты. Потребители. Поставщики предприятия. СМИ и общественность. Рыночные брокеры . Инвесторы. Рабочие и их профсоюзы. Макросреда предпринимательства: факторы. Классификация рисков по масштабам, формам и обстоятельствам их проявления. Системная классификация рисков по природе формирующих их факторов.
9	Международные стандарты риск менеджмента: ISO 31000:2009 Risk management - Principles and guidelines; ISO/IEC 31010:2009 Risk management; ISO Guide 73:2009 Risk management	Международные стандарты риск менеджмента. ISO 31000:2009 Risk management - Principles and guidelines. Менеджмент рисками - Принципы и Руководство. Взаимосвязь между принципами, системой и процессом управления рисками. Содержание стандарта ISO 31000: 2009. Термины и определения стандарта ИСО 31000:2009. Конструкция системы менеджмента риска. Стандарт ISO/IEC 31010:2009 "Менеджмент риска. Стандарт; ISO Guide 73:2009 Risk management
10	Управление финансовыми рисками	Понятие «финансовый риск». Факторы финансовых рисков. Классификация финансовых рисков в деятельности коммерческой организации. Содержание основных финансовых рисков в деятельности коммерческой организации. Суть и подходы в управлении финансовыми рисками. Методы (способы) управления финансовыми рисками. Принципы управления финансовыми рисками. Виды и содержание основных стратегий управления финансовыми рисками. Содержание базовых элементов системы управления финансовыми рисками. Процесс управления финансовыми рисками. Оценка и измерение финансовых рисков. Управление основными видами финансовых рисков
11	Управление нефинансовыми рисками	Понятие и классификация нефинансовых рисков. Общие принципы управления нефинансовыми рисками. Подходы к оценке нефинансовых рисков. Нефинансовые риски текущей деятельности организации. Нефинансовые риски предприятий при отраслевом реформировании.
12	Особенности и практика управления информационными рисками на основе цикла Демига	Понятие и сущность информационного риска. Информационная система и её элементы. Воздействие информационных рисков на процесс функционирования предприятия. Источники, причины и факторы информационных рисков.Модель нарушителя. Управление информационными рисками на основе Цикл Демига.

5.3. Лабораторный практикум

Лабораторный практикум не предусмотрен.

5.4. Практические (семинарские) занятия

Таблица 4

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела
1	Неопределенность и риск	Понятие и области проявления неопределённости. Признаки классификации неопределенностей. Типы (виды) неопределенности при принятии решения. Источники неопределенности. Взаимосвязь категорий «неопределенность» - «риск» - «потеря». Отличительные особенности понятий «неопределенность» и «риск».
2	Теория риска: функции и характерные черты риска	Классическая теория риска, неоклассическая теория риска и кейнсианская теория риска. Теория риска в советской экономической науке. Подходы современных экономических теорий в определении «риска». Основные факторы неопределенности, препятствующие хозяйственной и инвестиционной деятельности в России. Три подхода экономических теорий в определении понятия «риск». Функции риска. Характерные черты риска
3	Принципы менеджмента риска. Классификация рисков	Формирование системы принципов управления рисками. Основополагающие принципы управления рисками, которым надлежит следовать субъекту управления. Принципы, предлагаемые Международным стандартом ISO 31000:2009. Классификация рисков по времени возникновения. Классификации рисков по факторам возникновения. Классификация рисков по характеру последствий (экономического результата). **К**лассификация рисков по сфере возникновения. Классификация рисков по уровню последствия
4	Система риск-менеджмента. Процесс менеджмента риска	Понятие и содержание системы риск-менеджмента. Задачи системы менеджмента риска. Объект риск-менеджмента. Система лимитов на риск. Режимы функционирования системы риск-менеджмента . Этапы процесса менеджмента риска. Этапы процесса управления рисками, предложенные западными исследователями. Процесс менеджмента риска согласно Международному стандарту ISO 31000:2009. Стадии процесса управления риском
5	Методы управления рисками	Дособытийные методы управления рисками. Послесобытийные методы управления рисками. Организационные методы управления рисками. Методы уклонения от рисков. Методы локализации рисков. Методы диверсификации рисков. Методы компенсации риска**.** Методы контроля процесса выполнения планируемой программы мероприятий по снижению риска от реализации стратегии функционирования предприятия
6	Анализ рисков	Анализ рисков: содержание и общие принципы. Концепции анализа рисков, различающихся по исследуемым сферам его проявления. Анализ рисков на стратегическом, тактическом и оперативном уровнях. Блок-схема анализа риска. Концепция качественного анализа рисков. Количественный анализ рисков. Концепция количественного анализа рисков. Методы количественного анализа рисков. Качественные измерители риска
7	Менеджмент	Понятие предпринимательский риск. Сущность

	предпринимательских рисков: понятие, сущность и содержание.	предпринимательского риска. Внутренние риски. Внешним рискам. Краткосрочные риски. Постоянные риски. Производственный риск. Коммерческий риск. Финансовый риск
8	Факторы макро- и микросреды предпринимательства. Классификация предпринимательских рисков	Микросреда предпринимательства: факторы. Конкуренты. Потребители. Поставщики предприятия. СМИ и общественность. Рыночные брокеры . Инвесторы. Рабочие и их профсоюзы. Макросреда предпринимательства: факторы. Классификация рисков по масштабам, формам и обстоятельствам их проявления. Системная классификация рисков по природе формирующих их факторов.
9	Международные стандарты риск менеджмента: ISO 31000:2009 Risk management - Principles and guidelines; ISO/IEC 31010:2009 Risk management; ISO Guide 73:2009 Risk management	Международные стандарты риск менеджмента. ISO 31000:2009 Risk management - Principles and guidelines. Менеджмент рисками - Принципы и Руководство. Взаимосвязь между принципами, системой и процессом управления рисками. Содержание стандарта ISO 31000: 2009. Термины и определения стандарта ИСО 31000:2009. Конструкция системы менеджмента риска. Стандарт ISO/IEC 31010:2009 "Менеджмент риска. Стандарт; ISO Guide 73:2009 Risk management
10	Управление финансовыми рисками	Понятие «финансовый риск». Факторы финансовых рисков. Классификация финансовых рисков в деятельности коммерческой организации. Содержание основных финансовых рисков в деятельности коммерческой организации. Суть и подходы в управлении финансовыми рисками. Методы (способы) управления финансовыми рисками. Принципы управления финансовыми рисками. Виды и содержание основных стратегий управления финансовыми рисками. Содержание базовых элементов системы управления финансовыми рисками. Процесс управления финансовыми рисками. Оценка и измерение финансовых рисков. Управление основными видами финансовых рисков
11	Управление нефинансовыми рисками	Понятие и классификация нефинансовых рисков. Общие принципы управления нефинансовыми рисками. Подходы к оценке нефинансовых рисков. Нефинансовые риски текущей деятельности организации. Нефинансовые риски предприятий при отраслевом реформировании.
12	Особенности и практика управления информационными рисками на основе цикла Демига	Понятие и сущность информационного риска. Информационная система и её элементы. Воздействие информационных рисков на процесс функционирования предприятия. Источники, причины и факторы информационных рисков.Модель нарушителя. Управление информационными рисками на основе Цикл Демига.

6. Самостоятельная работа студентов по дисциплине

6.1. Способы организации самостоятельной работы студентов

Способы организации самостоятельной работы студентов следующие:

- аудиторная самостоятельная работа по дисциплине – работа, выполняемая на учебных практических занятиях под непосредственным руководством и контролем преподавателя и по его заданию;

- консультации, в рамках которых преподаватель, с одной стороны, оказывает индивидуальные консультации по ходу выполнения самостоятельных заданий, а с другой стороны, осуществляет контроль и оценивает результаты этих индивидуальных заданий;

- внеаудиторная самостоятельная работа – работа, выполняемая вне аудитории по заданию преподавателя, но без его непосредственного участия.

Формами внеаудиторной СРС являются: повторение лекционного материала, работа с учебной литературой, подготовка к практическим занятиям, конспектирование вопросов, которые следует изучить самостоятельно и другие.

6.2. Темы на самостоятельную подготовку к практическим занятиям

Таблица 5

№ п/п	Тематика	Кол-во часов	
		ОФО	ЗФО
Тема 1. Неопределенность и риск			
1.1.	Понятие и области проявления неопределённости.	0,5	0,5
1.2.	Типы (виды) неопределенности при принятии решения	0,5	0,5
1.3	Источники неопределенности.	0,5	0,5
1.4	Взаимосвязь категорий «неопределенность» - «риск» - «потеря».	0,5	0,5
Тема 2. Теория риска: функции и характерные черты риска			
2.1.	Классическая теория риска, неоклассическая теория риска и кейнсианская теория риска	1	1
2.2	Три подхода экономических теорий в определении понятия «риск».	1	1
Тема 3. Принципы менеджмента риска. Классификация рисков			
3.1	Принципы менеджмента риска.	1	1
3.2	Классификация рисков	0,5	0,5
3.3	Классификация рисков по времени возникновения. Классификации рисков по факторам возникновения	0,5	0,5
Тема 4. Система риск-менеджмента. Процесс менеджмента риска			
4.1	Понятие и содержание системы риск-менеджмента	0,5	0,5
4.2	Система лимитов на риск.	0,5	0,5
4.3	Этапы процесса менеджмента риска. Процесс менеджмента риска согласно Международному стандарту ISO 31000:2009	1	1
Тема 5. Методы управления рисками			
5.1	Дособытийные методы управления рисками. Послесобытийные методы управления рисками.	1	1
5.2	Организационные методы управления рисками.	0,5	0,5
5.3	Методы уклонения от рисков. Методы локализации рисков.	0,5	0,5
Тема 6. Анализ рисков			
6.1	Анализ рисков: содержание и общие принципы.	1	1
6.2	Концепция качественного анализа рисков. Количественный анализ рисков	0,5	0,5
6.3	Методы количественного анализа рисков. Метод ожидаемой денежной стоимости. Метод имитационного моделирования Монте-Карло. Количественный анализ рисков- анализ дерева решений.	0,5	0,5
Тема 7. Менеджмент предпринимательских рисков: понятие, сущность и содержание			
7.1	Понятие предпринимательский риск	1	1

7.2	Внутренние риски. Внешним рискам. Краткосрочные риски. Постоянные риски. Производственный риск . Коммерческий риск. Финансовый риск	1	1
Тема 8. Факторы макро- и микросреды предпринимательства. Классификация предпринимательских рисков			
8.1	Факторы макро- и микросреды предпринимательства.	1	1
8.2	Классификация предпринимательских рисков	1	1
Тема 9. Международные стандарты риск менеджмента: ISO 31000:2009 Risk management - Principles and guidelines; ISO/IEC 31010:2009 Risk management; ISO Guide 73:2009 Risk management			
9.1	Международные стандарты риск менеджмента. ISO 31000:2009 Risk management - Principles and guidelines. Менеджмент рисками - Принципы и Руководство	1	1
9.2	Стандарт ISO/IEC 31010:2009 "Менеджмент риска. Стандарт	0,5	0,5
9.3	Стандарт; ISO Guide 73:2009 Risk management	0,5	0,5
Тема 10. Управление финансовыми рисками			
10.1	Факторы финансовых рисков	0,5	0,5
10.2	Содержание основных финансовых рисков в деятельности коммерческой организации.	0,5	0,5
10.3	Методы (способы) управления финансовыми рисками.	0,5	0,5
10.4	Процесс управления финансовыми рисками.	0,5	0,5
Тема 11. Управление нефинансовыми рисками			
11.1	Понятие и классификация нефинансовых рисков.	1	1
11.2	Нефинансовые риски предприятий при отраслевом реформировании	1	1
Тема 12. Особенности и практика управления информационными рисками на основе цикла Демига			
12.1	Понятие и сущность информационного риска.	1	1
12.2	Модель нарушителя. Управление информационными рисками на основе Цикл Демига	1	1

Образцы заданий на самостоятельную подготовку студентов

Тема 1. Неопределенность и риск

Вопросы и задания для подготовки:

1. Признаки классификации неопределенностей.
2. Типы (виды) неопределенности при принятии решения
3. Отличительные особенности понятий «неопределенность» и «риск».

Тема 2. Теория риска: функции и характерные черты риска

Вопросы и задания для подготовки:

1. Классическая теория риска, неоклассическая теория риска и кейнсианская теория риска
2. Теория риска в советской экономической науке. Подходы современных экономических теорий в определении «риска».
3. Основные факторы неопределенности, препятствующие хозяйственной и инвестиционной деятельности в России
4. Три подхода экономических теорий в определении понятия «риск».

Тема 3. Принципы менеджмента риска. Классификация рисков

Вопросы и задания для подготовки:

1. Основополагающие принципы управления рисками, которым надлежит следовать субъекту управления. 2. Принципы, предлагаемые Международным стандартом ISO 31000:2009.

3. . Классификация рисков по времени возникновения. Классификации рисков по факторам возникновения

4. Классификация рисков по характеру последствий (экономического результата). **К**лассификация рисков по сфере возникновения. Классификация рисков по уровню последствия

Тема 4. Система риск-менеджмента. Процесс менеджмента риска

Вопросы и задания для подготовки:

1. Объект риск-менеджмента..
2. . Система лимитов на риск
3. Режимы функционирования системы риск-менеджмента
4. Этапы процесса менеджмента риска.
5. Процесс менеджмента риска согласно Международному стандарту ISO 31000:2009.

Тема 5. Методы управления рисками

Вопросы и задания для подготовки:

1. Дособытийные и после событийные методы управления рисками.
2. Стадии процесса управления риском.
3. Организационные методы управления рисками.
4. Методы уклонения от рисков. Методы локализации рисков.
5. Методы диверсификации рисков. Методы компенсации риска**.**

Тема 6 Анализ рисков

Вопросы и задания для подготовки:

1. Анализ рисков: содержание и общие принципы.
2. Концепции анализа рисков, различающихся по исследуемым сферам его проявления.
3. Анализ рисков на стратегическом, тактическом и оперативном уровнях.
4. Блок-схема анализа риска.
5. Концепция качественного анализа рисков. Количественный анализ рисков. Концепция количественного анализа рисков.
6. Методы количественного анализа рисков.
7. Метод ожидаемой денежной стоимости. Метод имитационного моделирования Монте-Карло. Количественный анализ рисков- анализ дерева решений
8. Этапы анализа рисков.

Тема 7. Менеджмент предпринимательских рисков: понятие, сущность и содержание

Вопросы и задания для подготовки:

1. Понятие предпринимательский риск
2. Внутренние риски. Внешним рискам.
3. Краткосрочные риски. Постоянные риски.
4. Производственный риск . Коммерческий риск. Финансовый риск

Тема 8. Факторы макро- и микросреды предпринимательства. Классификация предпринимательских рисков

Вопросы и задания для подготовки:

1. Микросреда предпринимательства: факторы
2. Макросреда предпринимательства: факторы
3. Классификация рисков по масштабам, формам и обстоятельствам их проявления.
4 Системная классификация рисков по природе формирующих их факторов.

Тема 9. Международные стандарты риск менеджмента: ISO 31000:2009 Risk management - Principles and guidelines; ISO/IEC 31010:2009 Risk management; ISO Guide 73:2009 Risk management

Вопросы и задания для подготовки:

1. Международные стандарты риск менеджмента. ISO 31000:2009 Risk management - Principles and guidelines. Менеджмент рисками - Принципы и Руководство. Содержание стандарта ISO 31000: 2009. Термины и определения стандарта ИСО 31000:2009. Конструкция системы менеджмента риска.
2. Взаимосвязь между принципами, системой и процессом управления рисками. .
3. Стандарт ISO/IEC 31010:2009 "Менеджмент риска.
4. Стандарт; ISO Guide 73:2009 Risk management .

Тема 10. Управление финансовыми рисками

Вопросы и задания для подготовки:

1. Понятие «финансовый риск». Факторы финансовых рисков.
2. Классификация финансовых рисков в деятельности коммерческой организации.
3. Содержание основных финансовых рисков в деятельности коммерческой организации.
4. Суть и подходы в управлении финансовыми рисками.
5. Принципы управления финансовыми рисками.
6. . Содержание базовых элементов системы управления финансовыми рисками.
7. Оценка и измерение финансовых рисков.
8. Управление основными видами финансовых рисков

Тема 11. Управление нефинансовыми рисками

Вопросы и задания для подготовки:

1. Общие принципы управления нефинансовыми рисками.
2. Подходы к оценке нефинансовых рисков
3. Основные правила разработки индикаторов.
4. Нефинансовые риски предприятий при отраслевом реформировании.

Тема 12. Особенности и практика управления информационными рисками на основе цикла Демига

Вопросы и задания для подготовки:

1. Информационная система и её элементы
2. Воздействие информационных рисков на процесс функционирования предприятия. Источники, причины и факторы информационных рисков..
3. Модель нарушителя.
4. Управление информационными рисками на основе Цикл Демига

6.3. Интерактивные образовательные технологии, используемые на аудиторных занятиях

Таблица 6

Вид занятия (Л,ПЗ)	Используемые интерактивные образовательные технологии	Количество часов/з.е	
		ОФО	ЗФО
Л	Лекция-диалог	24	8
ПЗ	Дискуссии, решение задач, разбор ситуаций	24	8
Итого:		48	16

При подготовке бакалавров используются инновационные технологии обучения: интерактивные лекции, лекции-диалоги, дискуссии, разбор ситуаций. В учебном процессе используются специализированные аудитории, оборудованные стендами, экранами, мультимедийной техникой. Изучение дисциплины предполагает организацию и проведение «гостевых» лекций профессоров отечественных и зарубежных вузов; пользование библиотекой, читальными залами с доступом к электронным базам данных и сети Internet. Технические средства обучения используются как на лекционных, так и на практических занятия

6.4. Темы для самостоятельного изучения

Таблица 7

№ семинара	**Темы для самостоятельного изучения**	**Кол-во часов**	
		ОФО (ч)	**ЗФО (ч.)**
	8 семестр		
1	Управление финансовыми рисками.	2	4
2	Управление нефинансовыми рисками.	2	4
3	Управление стратегическими рисками.	2	4
4	Теория управления рисками.	2	4
5	Правило математического сложения рисков.	2	4
6	Правило поглощения рисков.	2	4
7	Инвестиционные риски.	2	4
8	Виды рисков. Чистые риски. Спекулятивные риски.	2	4
9	Задачи управления рисками в инвестиционной деятельности.	2	4
10	Цикл управления рисками инвестиционной деятельности	2	4
11	Сущность управления рисками.	2	4
12	Источники неопределенности инвестиционной деятельности.	2	4
13	Взаимосвязь и отличительные особенности риска и неопределенности.	2	6
14	Вероятностный подход в оценке риска.	2	6
15	Минимаксный подход в оценке риска.	2	6
16	Параметрические модели оценки уровня риска.	2	6
17	Метод бальной оценки в измерении уровня риска.	2	6
18	Теория нечеткости множества в оценке степени риска.	2	6

6.5.Учебно-методическое обеспечение для самостоятельной работы студентов

Основная литература

1. Барбаумов, В.Е. Энциклопедия финансового риск-менеджмента [Электронный ресурс] / В.Е. Барбаумов, М.А. Рогов, Д.Ф. Щукин, Н.Ю. Ситникова ; под ред. А. А. Лобанова, А. В. Чугунова. — Электрон. дан. — Москва : Альпина Паблишер, 2016. — 932 с. — Режим доступа: https://e.lanbook.com/book/95371. — Загл. с экрана.

2. Риск-менеджмент в коммерческом банке [Электронный ресурс] : монография / под ред. Ларионовой И.В.. — Электрон. дан. — Москва : КноРус, 2014. — 456 с. — Режим доступа: https://e.lanbook.com/book/53532. — Загл. с экрана.

3. Селюков, В.К. Риск-менеджмент организации [Электронный ресурс] : учебное пособие / В.К. Селюков. — Электрон. дан. — Москва : МГТУ им. Н.Э. Баумана, 2008. — 188 с. — Режим доступа: https://e.lanbook.com/book/58572. — Загл. с экрана.

4. Тепман Л.Н. Управление банковскими рисками [Электронный ресурс]: учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по направлениям экономики и управления/ Тепман Л.Н., Эриашвили Н.Д.— Электрон. текстовые данные.— М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2015.— 311 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/52649.html.— ЭБС «IPRbooks»

5. Цакаев А.Х. Менеджмент риска в кредитной организации. Учебное пособие. – М.: Анкил, 2012. – 576 с.

Дополнительная литература

1. Астахов А.М. Искусство управления информационными рисками [Электронный ресурс]/ Астахов А.М.— Электрон. текстовые данные.— Саратов: Профобразование, 2017.— 312 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/63803.html.— ЭБС «IPRbooks»

2. Каранина Е.В. Управление финансовыми рисками. Стратегические модели и профессиональные стандарты [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Каранина Е.В.— Электрон. текстовые данные.— СПб.: Интермедия, 2017.— 152 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/66803.html.— ЭБС «IPRbooks»

3. Кулешова Е.В. Управление рисками проектов [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Кулешова Е.В.— Электрон. текстовые данные.— Томск: Томский государственный университет систем управления и радиоэлектроники, Эль Контент, 2015.— 188 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/72205.html.— ЭБС «IPRbooks»

4.Роджер Гибсон Формирование инвестиционного портфеля [Электронный ресурс]: управление финансовыми рисками/ Роджер Гибсон— Электрон. текстовые данные.— М.: Альпина Паблишер, Альпина Бизнес Букс, 2016.— 276 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/41496.html.— ЭБС «IPRbooks»

7. Оценочные средства

7.1.Вопросы к 1-й рубежной аттестации

1. Понятие и области проявления неопределенности.
2. Признаки классификации неопределенностей.
3. По степени неопределенности существуют неопределенности, перечислить, дать определение.
4. По использованию информации в ходе управления: определение неопределенностей, классификация.
5. Типы (виды) неопределенности при принятии решения.
6. Отличительные особенности понятий «неопределенность» и «риск».
7. Теории риска.

8. Функции риска.

9. Характерные черты риска.

10. Основополагающие принципы управления рисками, которым надлежит следовать субъекту управления.

11. Какие принципы управления рисками предлагает Международный стандарт ISO 31000:2009.

12. Классификация рисков по времени возникновения.

13. Классификации рисков по факторам возникновения.

14. Классификация рисков по характеру последствий (экономического результата).

15. Классификация рисков по сфере возникновения.

16. Классификация рисков по уровню последствия.

17. Политические риски.

18. Кредитные риски.

19. Цель и задачи системы менеджмента риска.

20. Система лимитов на риск.

21. Этапы процесса управления рисками, предложенные западными исследователями.

22. Процесс менеджмента риска согласно Международному стандарту ISO 31000:2009.

7.2.Вопросы к 2-й рубежной аттестации

1. Организационные методы управления рисками на предприятии.

2. Методы контроля процесса выполнения планируемой программы мероприятий по снижению риска от реализации стратегии функционирования предприятия.

3. Зарубежные методы оценки риска.

4. Основная цель анализа рисков. Что включает в себя анализ рисков.

5. Концепции анализа рисков, различающихся по исследуемым сферам его проявления.

6. Анализ рисков на стратегическом, тактическом и оперативном уровнях.

7. Блок-схема анализа риска.

8. Качественный анализ риска: определение, преимущества. Концепция качественного анализа рисков.

9. Классификация анализа рисков.

10. Определение количественного анализа рисков. Концепция количественного анализа рисков.

11. Методы количественного анализа рисков.

12. Этапы анализа рисков.

13. Характеристики этапов экономического анализа рисков инвестиционной деятельности.

14. Метод бальной оценки уровня (степени) риска в деятельности организации.

15. Многофакторные линейные модели оценки риска: модель Альтмана, Модель Жованикова-Масловой.

16. Международные стандарты риск менеджмента. Содержание стандарта ISO 31000: 2009.

17. Взаимосвязь между принципами, системой и процессом управления рисками

18. Для чего предназначен стандарт ISO 31000?

19. Стандарт риск менеджмента FERMA: регламент управления риском, содержание стандарта

20. Российские стандарты риск менеджмента.

21. Риски, связанные с покупательной способностью денег.

22. Инвестиционные риски.

23. Сущность основных видов финансовых рисков.
24. Рыночные риски: определение, основные особенности и классификация.
25. Основные характеристики рыночных рисков.
26. Рыночные риски, присущие финансовым инструментам.
27. Подходы к управлению финансовыми рисками.
28. Методы (способы) управления финансовыми рисками.
29. Принципы управления финансовыми рисками.
30. Стратегии нейтрализации финансовых рисков.

Образец тестов к 1-й промежуточной аттестации

ТЕСТ

1. По степени неопределенность подразделяется на:
   а) устранимая и неустранимая;
   б) параметрическая, структурная и ситуационная;
   в) вероятностная, лингвистическая, интервальная и полная.
2. Разновидности теории риска:
   а) классическая, неоклассическая и кейнсианская;
   б) рыночная, плановая и директивная;
   в) административно-хозяйственная и плановая
3. Стадии риска:
   а) зарождение, рост, падение;
   б) выпуск; обращение, гашение;
   в) рисковая ситуация, действие, результат.
4. Функции риска:
   а) регулятивная, защитная, компенсирующая и социально-экономическая
   б) распределительная, регулирующая и контрольная;
   в) распределительная и контрольная
5. Какие черты не свойственны риску:
   а) альтернативность
   б) небезразличность
   в) целесообразность
   г) всеобщность
   д) факторность
   е) ситуационность
6. Нейтивные рискообразующие факторы – это факторы:
   а) воздействующие только на конкретный вид риска
   б) оказывающие влияние на риски сразу нескольких видов
7. По времени возникновения риски распределяются на:
   а) ситуационные, плановые и оперативные,
   б) ретроспективные, текущие и перспективные
   в) финансовые и предпринимательские
8. По характеру последствий риски подразделяют на:
   а) коммерческие и политические
   б) прямые и финансовые
   в) чистые и спекулятивные
   г) чистые и селективные
   д) производственные и коммерческие
9. Какие методы управления и анализа риска используют в условиях полной неопределенности:
   а) финансовые
   б) диссипации
   в) статистические
   г) математические
   д) экспертные

10. Риск потерь в процессе финансово – хозяйственной деятельности это:
а) спекулятивные риски
б) производственный риск
в) коммерческий риск
г) финансовый риск

Образец тестов к 2-й промежуточной аттестации

ТЕСТ

1. Что выступает товаром в финансовом предпринимательстве?
а) деньги и валюта;
б) ценные бумаги и производные финансовые инструменты;
в) а и б вместе взятые.
2. Какому типу рисков относится финансовый риск?
а) чистых рисков;
б) спекулятивных рисков;
в) а и б вместе взятых.
3. Какие существуют факторы финансовых рисков?
а) объективные;
б) субъективные;
в) а и б вместе взятые.
4. Какие подходы выделяют при расчете VAR?
а) эмпирический;
б) логический;
в) оценочный;
г) ранжирование;
д) параметрический.
5. Кто является владельцем финансовых рисков в организации?
а) менеджмент;
б) собственник;
в) а и б вместе взятые.
6. В чем специфичность проявления рыночных рисков?
а) нестабильности развития отрасли экономики;
б) нестабильности финансовых рынков;
в) а и б вместе взятые.
7. С каким финансовым инструментом законодательно принято связывать валютный риск?
а) облигация;
б) акция;
в) валюта.
8. С каким финансовым инструментом законодательно принято связывать процентный риск?
а) облигация;
б) акция;
в) валюта.
9. С каким финансовым инструментом законодательно принято связывать фондовый риск?
а) облигация;
б) акция;
в) валюта.
10. Какие существуют методы защиты от финансовых рисков?
а) физическая защита;
б) экономическая защита;
в) а и б вместе взятые.

.

7.3. Вопросы к зачету

1. Три подхода в определении понятия риск;
2. Понятие «риск» в теории оптимального управления;
3. Понятие «риск» в теории исторического и технологического прогресса;
4. Понятие «риск» в теории энтрапических (неравновесных) процессов экономического развития;
5. Сущность и содержание неопределенности;
6. Параметры и шкала нестабильности (неопределенности) внешней среды;
7. Факторы неопределенности в деятельности человека;
8. Основные факторы неопределенности, препятствующие инвестиционной деятельности в России;
9. Риск как особая форма проявления неопределенности;
10. Источник риска и рискообразующий фактор и их причинно-следственная связь;
11. Ключевые внутренние и внешние факторы риска согласно ISO/IEC Guide 73.
12. Признаки риска;
13. Функции риска;
14. Характерные черты риска;
15. Стадии риска;
16. Признаки классификации риска;
17. Классификация рисков по уровню экономической системы;
18. Классификация рисков по формату отражения в модели стоимости актива;
19. Классификация рисков по масштабу последствия;
20. Классификация рисков по способу оценки вероятности;
21. Классификация рисков по характеру экономического результата;
22. Классификация рисков по продолжительности во времени;
23. Классификация рисков по возможности страхования;
24. Классификация рисков по сфере возникновения;
25. Классификация рисков по источникам возникновения;
26. Классификация критически важных объектов по видам угроз;
27. Классификация критически важных объектов по уровням угроз;
28. Параметры и зоны кривой риска;
29. Графическая иллюстрация и интерпретация толерантности субъекта к риску на основе кривых доходности и ликвидности от уровня риска;
30. Взаимосвязь мотивации достижения с уровнем рискованности;
31. История становления комплексного риск-менеджмента;
32. Старая и новая методология (парадигма) риск-менеджмента;
33. Факторы, повлиявшие на внедрение ERM- систем;
34. Риск-менеджмент и этапы его становления;
35. Оценка риска на основе МБО и построения моделей влияния РОФ;
36. Понятие и содержание системы менеджмента риска;
37. Взаимосвязь ликвидности баланса, ликвидности деятельности и платежеспособности организации;
38. Сущность и содержание системы лимитов на риск;
39. Многофакторные линейные модели оценки риска;
40. Сущность и содержание системы лимитов на риск;
41. Многофакторные линейные модели оценки риска;
42. Система лимитов на риск;

Успеваемость студента дневной формы обучения определяется на основе БРС, представленной на сайте ГГНТУ им. акад. М.Д. Миллионщикова.

7.5. Образец билета к проведению зачета

ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ

БИЛЕТ № 1

Дисциплина Экономические риски деятельности предприятий

Институт Экономики и права **группа ЭНГ-18 семестр 6**

1. Понятие «риск» в теории оптимального управления;
2. Стадии риска.
3. Функции риска

УТВЕРЖДАЮ:

«___»_____20__г. *Зав. кафедрой* _____Т.В. Якубов

Образец текущего контроля

ТЕСТ

1. Информационный риск – это:

a) возможное событие, в результате которого несанкционированно удаляется и искажается информация;

b) возможное событие, в результате которого нарушается конфиденциальность (доступность) информации;

c) a и b вместе взятые.

2. Что является первичным в управлении финансовыми рисками?

а) политика управления финансовыми рисками;

б) принципы управления финансовыми рисками;

в) методы (способы) управления финансовыми рисками.

3. Объектом управления финансовыми рисками являются –

а) финансовые отношения;

б) владелец риска;

в) информационное обеспечение.

4. Какие сделки являются носителями кредитного риска?

а) сделки по предоставлению во временное пользование денежных средств;

б) сделки по продажи активов без предоплаты;

в) а и б вместе взятые.

4. Какие сделки являются носителями кредитного риска?

а) сделки по предоставлению во временное пользование денежных средств;

б) сделки по продажи активов без предоплаты;

в) а и б вместе взятые.

5. Что является результирующим в модели оценки кредитного риска?

а) оценка ожидаемых потерь;

б) распределение неожиданных потерь;

в) а и б вместе взятые.

6. Какой не финансовый риск доминирует в условиях принятия инвестиционных решений?

a) политический;
b) производственный;
c) корпоративного управления.

7. Производственные риски возникают в процессе:

a) производства и научно-исследовательских и конструкторских разработок (НИОКР);
b) реализации и послереализационного обслуживания продукции (услуг);
c) a и b вместе взятые.

8. Какой нефинансовый риск доминирует в текущей деятельности производственной компании?

a) политический;
b) производственный;
c) корпоративного управления.

9. К фондовым операциям относятся.

а) пассивные операции;
б) активные операции;
в) а и б вместе взятые.

10. Каков набор коэффициентов ликвидности используется для производственных компаний?

а) коэффициенты абсолютной, срочной и текущей ликвидности;
б) коэффициенты мгновенной, текущей и долгосрочной ликвидности;
в) а и б вместе взятые.

8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

а) основная литература

1. Барбаумов, В.Е. Энциклопедия финансового риск-менеджмента [Электронный ресурс] / В.Е. Барбаумов, М.А. Рогов, Д.Ф. Щукин, Н.Ю. Ситникова ; под ред. А. А. Лобанова, А. В. Чугунова. — Электрон. дан. — Москва : Альпина Паблишер, 2016. — 932 с. — Режим доступа: https://e.lanbook.com/book/95371. — Загл. с экрана.

2. Риск-менеджмент в коммерческом банке [Электронный ресурс] : монография / под ред. Ларионовой И.В.. — Электрон. дан. — Москва : КноРус, 2014. — 456 с. — Режим доступа: https://e.lanbook.com/book/53532. — Загл. с экрана.

3. Селюков, В.К. Риск-менеджмент организации [Электронный ресурс] : учебное пособие / В.К. Селюков. — Электрон. дан. — Москва : МГТУ им. Н.Э. Баумана, 2008. — 188 с. — Режим доступа: https://e.lanbook.com/book/58572. — Загл. с экрана.

4. Тепман Л.Н. Управление банковскими рисками [Электронный ресурс]: учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по направлениям экономики и управления/ Тепман Л.Н., Эриашвили Н.Д.— Электрон. текстовые данные.— М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2015.— 311 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/52649.html.— ЭБС «IPRbooks»

5. Цакаев А.Х. Менеджмент риска в кредитной организации. Учебное пособие. – М.: Анкил, 2012. – 576 с.

б) дополнительная литература

Астахов А.М. Искусство управления информационными рисками [Электронный ресурс]/ Астахов А.М.— Электрон. текстовые данные.— Саратов: Профобразование, 2017.— 312 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/63803.html.— ЭБС «IPRbooks»

2. Каранина Е.В. Управление финансовыми рисками. Стратегические модели и профессиональные стандарты [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Каранина Е.В.—

Электрон. текстовые данные.— СПб.: Интермедия, 2017.— 152 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/66803.html.— ЭБС «IPRbooks»

3. Кулешова Е.В. Управление рисками проектов [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Кулешова Е.В.— Электрон. текстовые данные.— Томск: Томский государственный университет систем управления и радиоэлектроники, Эль Контент, 2015.— 188 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/72205.html.— ЭБС «IPRbooks»

4.Роджер Гибсон Формирование инвестиционного портфеля [Электронный ресурс]: управление финансовыми рисками/ Роджер Гибсон— Электрон. текстовые данные.— М.: Альпина Паблишер, Альпина Бизнес Букс, 2016.— 276 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/41496.html.— ЭБС «IPRbooks»

в) Интернет-ресурс:

1. www.cbr.ru – Сайт Центрального банка РФ
2. www.minfin.ru – Сайт Министерства финансов РФ.
3. /www.banki.ru. - Официальный сайт ИА ?Банки.ру
4. www.nalog.ru – Сайт ФНС

9. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Лекционный кабинет, оборудованный интерактивной доской и проектором.
Раздаточный материал для проведения практических занятий.

Составитель

Доцент кафедры «Экономика

и управление на предприятии» Л.А. Мусаев

СОГЛАСОВАНО

Зав. выпуск. каф. «Экономика

и управление на предприятии» Т.В.Якубов

Директор ДУМР М.А. Магомаева