

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Минцаев М.Д. Шаварзин

Должность: Ректор

Дата подписания: 17.10.2020 11:02:24

Уникальный программный ключ:

236bcc35c296f119d6aafdc22836b21db52dbc07971a86865a582519fa4304cc

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
имени академика М.Д. Миллионщикова



РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины

«ЭКОНОМИЧЕСКИЕ РИСКИ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ПРЕДПРИЯТИЙ»

Направление подготовки

38.03.01 Экономика

Профиль

«Экономика предприятий и организаций (в строительстве)»

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:

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 | |
|---|------------------------------|-----------------|------------|------------|
| | ОЗФО | ЗФО | ОЗФО | ЗФО |
| | ОЗФО | ЗФО | 9 | 6 |
| Контактная работа (всего) | 18/0,5 | 16/0,4 | 18 | 16 |
| В том числе: | | | | |
| Лекции (Л) | 9/0,3 | 8/0,2 | 9 | 8 |
| Практические занятия (ПЗ) | 9/0,3 | 8/0,2 | 9 | 8 |
| Семинары (С) | - | - | - | - |
| Лабораторные работы (ЛР) | - | - | - | - |
| Самостоятельная работа(всего) | 126/3,5 | 128 /3,6 | 126 | 128 |
| В том числе: | | | | |
| Курсовая работа (КР) | - | - | - | - |
| Расчетно-графические работы (РГР) | - | - | - | - |
| И(или) другие виды самостоятельной работы: | 126/3,5 | 128/3,6 | 126 | 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 | 72/2,0 | 36/1 | 72 | 36 |
| Вид отчетности | зачет | зачет | зачет | зачет |
| Общая трудоемкость дисциплины | ВСЕГО в часах | 144 | 144 | 144 |
| | ВСЕГО в зач. единицах | 4 | 4 | 4 |

5. Содержание дисциплины

5.1. Разделы дисциплины и виды занятий

Таблица 2

| № п/п | Наименование раздела дисциплины | ОЗФО | | |
|---------------|--|--------------|----------------------|-------------|
| | | 9 семестр | | |
| | | Лекции (час) | Практ. занятия (час) | Всего (час) |
| 1 | Теоретические основы менеджмента риска | 2 | 2 | 4 |
| 2 | Методология менеджмента риска | 5 | 5 | 10 |
| 3 | Управление финансовыми и нефинансовыми рисками | 2 | 2 | 4 |
| Итого: | | 9 | 9 | 18 |

| № п/п | Наименование раздела дисциплины | Содержание раздела |
|-------|--|--|
| 1 | <p>Раздел 1. Теоретические основы менеджмента риска</p> <p>Неопределенность и риск. Теория риска: функции и характерные черты риска</p> | <p>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». 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</p> |
| 2 | <p>Раздел 2. Методология менеджмента риска</p> <p>Принципы менеджмента риска. Система риск-менеджмента. Процесс менеджмента риска</p> | <p>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). Классификация рисков по сфере возникновения. Классификация рисков по уровню последствия. 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</p> |
| 3 | <p>Методы управления рисками</p> | <p>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</p> |
| 4 | <p>Анализ рисков</p> | <p>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</p> |

| | | |
|---|--|---|
| 5 | <p>Раздел 3. Управление финансовыми и нефинансовыми рисками</p> <p>Управление финансовыми рисками. Управление нефинансовыми рисками</p> | <p>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. 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.</p> |
|---|--|---|

5.3 Лабораторный практикум

Лабораторный практикум не предусмотрен.

5.4 Практические (семинарские) занятия

Таблица 4

| № п/п | Наименование раздела дисциплины | Содержание раздела |
|-------|--|--|
| 1 | <p>Раздел 1. Теоретические основы менеджмента риска</p> <p>Неопределенность и риск. Теория риска: функции и характерные черты риска</p> | <p>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». 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</p> |
| 2 | <p>Раздел 2. Методология менеджмента риска</p> <p>Принципы менеджмента риска. Система риск-менеджмента. Процесс менеджмента риска</p> | <p>Формирование системы принципов управления рисками. Основопологающие 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). Классификация рисков по сфере возникновения. Классификация рисков по уровню последствия. Понятие и содержание системы риск-менеджмента. Задачи</p> |

| | | |
|---|---|--|
| | | 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 |
| 3 | 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 |
| 4 | 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 |
| 5 | Раздел 3. Управление финансовыми и нефинансовыми рисками Управление финансовыми рисками. Управление нефинансовыми 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. 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. |

6. Самостоятельная работа студентов по дисциплине

6.1. Темы на самостоятельную подготовку к практическим занятиям

Таблица 5

| № п/п | Тематика | Кол-во часов | |
|---|---|--------------|------|
| | | ОЗФО | ЗФО |
| Тема 1. Неопределенность и риск. Теория риска: функции и характерные черты риска | | | |
| 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. | 0,25 | 0,25 |
| 1.4 | Взаимосвязь категорий «неопределенность» - «риск» - «потеря». | 0,25 | 0,25 |
| 1.5. | Классическая теория риска, неоклассическая теория риска и кейнсианская теория риска | 0,25 | 0,25 |

| | | | |
|---|--|------|------|
| 1.6 | Три подхода экономических теорий в определении понятия «риск». | 0,25 | 0,25 |
| Тема 2. Принципы менеджмента риска. Система риск-менеджмента. Процесс менеджмента риска. | | | |
| 2.1 | Принципы менеджмента риска. | 0,5 | 0,5 |
| 2.2 | Классификация рисков | 0,5 | 0,5 |
| 2.3 | Понятие и содержание системы риск-менеджмента | 0,25 | 0,25 |
| 2.4 | Система лимитов на риск. | 0,25 | 0,25 |
| 2.5 | Этапы процесса менеджмента риска | 0,25 | 0,25 |
| 2.6 | Процесс менеджмента риска согласно Международному стандарту ISO 31000:2009 | 0,25 | 0,25 |
| Тема 3. Методы управления рисками | | | |
| 3.1 | Дособытийные методы управления рисками. Послесобытийные методы управления рисками. | 1 | 1 |
| 3.2 | Организационные методы управления рисками. | 0,5 | 0,5 |
| 3.3 | Методы уклонения от рисков. Методы локализации рисков. | 0,5 | 0,5 |
| Тема 4. Анализ рисков | | | |
| 4.1 | Анализ рисков: содержание и общие принципы. | 1 | 1 |
| 4.2 | Концепция качественного анализа рисков. Количественный анализ рисков | 0,5 | 0,5 |
| 4.3 | Методы количественного анализа рисков. Метод ожидаемой денежной стоимости. Метод имитационного моделирования Монте-Карло. Количественный анализ рисков- анализ дерева решений. | 0,5 | 0,5 |
| Тема 5. Управление финансовыми рисками. Управление нефинансовыми рисками | | | |
| 5.1 | Факторы финансовых рисков | 0,5 | 0,5 |
| 5.2 | Содержание основных финансовых рисков в деятельности коммерческой организации. | 0,5 | 0,5 |
| 5.3 | Методы (способы) управления финансовыми рисками. | 0,25 | 0,25 |
| 5.4 | Процесс управления финансовыми рисками. | 0,25 | 0,25 |
| 5.5 | Понятие и классификация нефинансовых рисков. | 0,25 | 0,25 |
| 5.6 | Нефинансовые риски предприятий при отраслевом реформировании | 0,25 | 0,25 |

Образцы заданий на самостоятельную подготовку студентов

Тема 1. Неопределенность и риск. Теория риска: функции и характерные черты риска

Вопросы и задания для подготовки:

1. Признаки классификации неопределенностей.
2. Типы (виды) неопределенности при принятии решения
3. Отличительные особенности понятий «неопределенность» и «риск».
4. Классическая теория риска, неоклассическая теория риска и кейнсианская теория риска
5. Теория риска в советской экономической науке. Подходы современных экономических теорий в определении «риска».
6. Основные факторы неопределенности, препятствующие хозяйственной и инвестиционной деятельности в России
7. Три подхода экономических теорий в определении понятия «риск».

Тема 2. Принципы менеджмента риска. Система риск-менеджмента. Процесс менеджмента риска

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).

Классификация рисков по сфере возникновения. Классификация рисков по уровню последствия

5. Объект риск-менеджмента..

6. Система лимитов на риск

7. Режимы функционирования системы риск-менеджмента

8. Этапы процесса менеджмента риска.

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

Тема 3. 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 4 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 5. Управление финансовыми рисками. Управление нефинансовыми 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
9. Общие принципы управления нефинансовыми рисками.
10. Подходы к оценке нефинансовых рисков
11. Основные правила разработки индикаторов.
12. Нефинансовые риски предприятий при отраслевом реформировании.

6.2. Интерактивные образовательные технологии, используемые на аудиторных занятиях

Таблица 6

| Вид занятия (Л,ПЗ) | Используемые интерактивные образовательные технологии | Количество часов/з.е | |
|--------------------|---|----------------------|-----|
| | | ОЗФО | ЗФО |
| Л | Лекция-диалог | 9 | 8 |
| ПЗ | Дискуссии, решение задач, разбор ситуаций | 9 | 8 |
| Итого: | | 18 | 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 занятиях

6.3. 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. Шукин, 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 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 энтропических (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
ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ**

ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ

БИЛЕТ № 1

Дисциплина Экономические риски деятельности предприятий

Институт Экономики и права группа ВЭС-20 семестр 9

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:
 - а) возможное событие, в результате которого несанкционированно удаляется и искажается информация;
 - б) возможное событие, в результате которого нарушается конфиденциальность (доступность) информации;
 - с) а и б 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 продаже 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 продаже 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?
 - а) политический;
 - б) производственный;
 - с) корпоративного управления.
7. Производственные риски возникают в процессе:
 - а) производства и научно-исследовательских и конструкторских разработок (НИОКР);
 - б) реализации и послереализационного обслуживания продукции (услуг);
 - с) а и б вместе взятые.
8. Какой нефинансовый риск доминирует в текущей деятельности производственной компании?
 - а) политический;
 - б) производственный;
 - с) 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. Шукин, 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](http://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