

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Шебзухова Татьяна Александровна
Должность: Директор Пятигорского института (филиал) Северо-Кавказского
федерального университета
Дата подписания: 24.08.2023 16:19:06
Уникальный программный ключ:
d74ce93cd40e39275c3ba2f58486412a1c8ef96f

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ И РОССИЙСКОЙ
ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ АВТОНОМНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«СЕВЕРО-КАВКАЗСКИЙ ФЕДЕРАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»
ПЯТИГОРСКИЙ ИНСТИТУТ (ФИЛИАЛ) СКФУ

Методические указания по выполнению практических работ
по дисциплине «Управление корпоративными рисками»
для студентов направления подготовки 38.03.01 «Экономика»
Направленность (профиль): «Корпоративная экономика и финансы»

**ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН
ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ**
Сертификат: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6
Владелец: Шебзухова Татьяна Александровна
Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022

**Пятигорск
2022**

СОДЕРЖАНИЕ

ВВЕДЕНИЕ.....	3
МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ ПО ОРГАНИЗАЦИИ ПРАКТИЧЕСКИХ ЗАНЯТИЙ.....	3
СПИСОК РЕКОМЕНДУЕМОЙ ЛИТЕРАТУРЫ.....	15

**ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН
ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ**

Сертификат: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6

Владелец: Шебзухова Татьяна Александровна

Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022

ВВЕДЕНИЕ

Цель дисциплины «Управление корпоративными рисками» является формирование у обучаемых компетенций, позволяющих им успешно применять знания, навыки и умения в области риск-менеджмента для решения профессиональных задач повышения эффективности деятельности организаций различных форм собственности путем разработки и совершенствования их процессов или административных регламентов. Студенты получают представление о современном состоянии данной интенсивно развивающейся в последние годы финансовой индустрии и об основных методах в международной и отечественной практике.

Задачами освоения дисциплины «Управление корпоративными рисками» являются:

1. сформировать у обучаемых целостное представление (систему знаний) о сущности, содержании, актуальности, логике и методах деятельности по управлению рисками хозяйствующего субъекта как комплексного бизнес процесса;
2. развить у обучаемых умения принимать своевременные и всесторонне обоснованные решения по вопросам профилактики и минимизации рисков хозяйственной деятельности организаций (предприятий) различных форм собственности в интересах повышения эффективности их деятельности путем разработки и совершенствования организационных процессов или административных регламентов, в том числе с использованием современных информационных и телекоммуникационных технологий;
3. подготовка к практической деятельности в области риск – менеджмента.

МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ ПО ОРГАНИЗАЦИИ ПРАКТИЧЕСКИХ ЗАНЯТИЙ

Практическое занятие №1. Теоретические основы риск – менеджмента

Цель данного практического занятия – изучить методы идентификации, измерения и картографирования рисков

В результате освоения темы обучающийся должен:

Код компетенции ИД-4 ПК – 5; ИД-2 ПК - 6

выполняет необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывать их и представлять результаты и обзоры

осуществляет подготовку предложений по инвестиционным проектам в соответствии с критериями их рыночной привлекательности, целями и критериями отбора

проводит оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта

Теоретическая часть:

Риск является как философской, так и исторической и экономической категорией. Риск возник уже на низшей ступени цивилизации и связан, в частности, с появлением у человека чувства страха перед возможной опасностью и более всего перед смертью. Слово «риск» имеет испано-португальские корни и означает «риф», «подводная скала», что ассоциируется с понятием «лабиринт между скалами», а значит, сопряжено с

чувством опасности

В данном документе используется однозначного толкования термина «риск».

Сертификат: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6
Владелец: Шебзухова Татьяна Александровна
Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022

Вопросы для обсуждения на практических занятиях:

- | Рекомендуемые источники информации (№ источника) | | | |
|--|----------------|--------------|------------------|
| Основная | Дополнительная | Методическая | Интернет-ресурсы |
| 1 | 1 | 1-2 | 1-7 |

Вопросы для обсуждения на практических занятиях:

6. Системная классификация рисков по природе формирующих их факторов.

4

			ресурсы
1	1	1-2	1-7

Практическое занятие №3. Концепции и методический инструментальный риск - менеджмента

Цель данного практического занятия – изучить теоретические и методологические основы риск-менеджмента

В результате освоения темы обучающийся должен:

Код компетенции ИД-4 ПК – 5; ИД-2 ПК - 6

выполняет необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывать их и представлять результаты и обзоры

осуществляет подготовку предложений по инвестиционным проектам в соответствии с критериями их рыночной привлекательности, целями и критериями отбора

проводит оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта

Теоретическая часть:

Концепции риск-менеджмента заключаются в том, что сам риск-менеджмент является относительно молодым направлением, которое призвано улучшить деятельность предприятия. Несмотря на это, данное направление быстро набирает темп.

Концепции риск-менеджмента находят свое отражение в специальных стандартах, таких как:

ISO 31000:2010 Менеджмент риска. Принципы и руководство,

ISO 73:2009 Менеджмент риска. Словарь,

AS/NZS 4360:2004 «Риск-менеджмент» и др.

В нашей стране концепции риск-менеджмента пока не находят широкого применения, в отличие от зарубежных стран. Крупнейшие европейские компании давно внедрили концепции «риск-менеджмента» в свою работу и продолжают это делать.

Сущность риск-менеджмента

Риск-менеджмент включает в себя систему управленческих решений, которые сконцентрированы на минимизации вероятного возникновения неблагоприятных результатов и уменьшение возможных потерь. Риск-менеджмент дает возможность компании предусматривать риски проекта, определять их вероятность, разрабатывать стратегии поведения в ситуациях риска. Концепция способствует экономии ресурсов и росту деловой репутации.

Первоначально концепции риск-менеджмента были затронуты в статье, которую опубликовали в 1956 году в Америке. Основная мысль статьи заключалась в том, что предприятиям для уменьшения экономических потерь необходимо использовать труд специалистов управления рисками. Особую интенсивность размышления о риске приняли во второй половине 20 века.

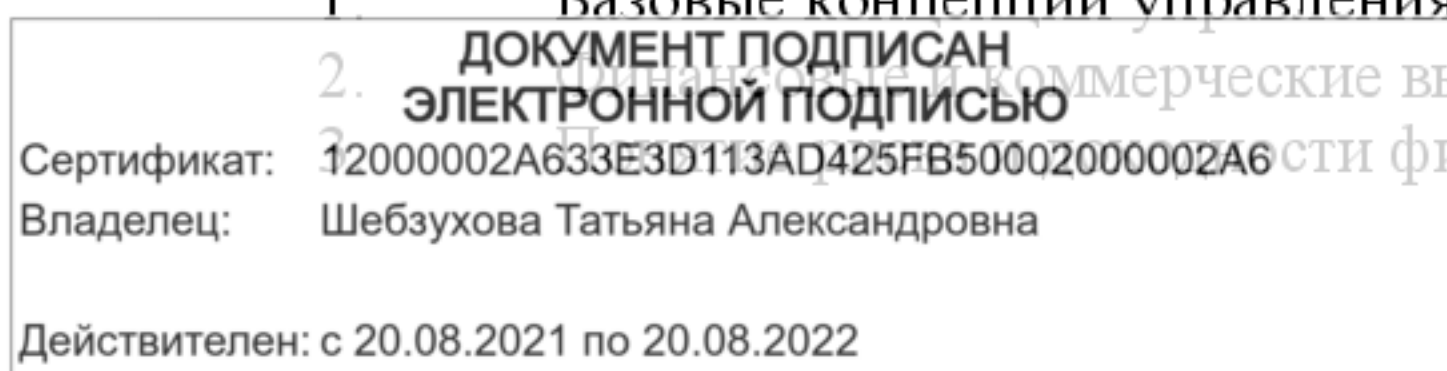
Так, с целью прогнозирования поведения компании в рискованных условиях, стали использовать методы математической статистики. В бизнесе концепции риск-менеджмента начали завоевывать популярность в 70-е годы 20 века. Тогда происходило зарождение услуг в сфере оказания консультаций по оценке риска, при этом основной упор делали на воздействие факторов экономической нестабильности в определенном государстве.

Вопросы для обсуждения на практических занятиях:

1. Базовые концепции управления рисками.

2. Влияние коммерческих вычислений в исторической ретроспективе.

3. Взаимосвязь факторов финансовой операции и их взаимосвязь.



4. Безрисковая норма доходности.
5. Статистические показатели в риск – менеджменте.
6. Определение настоящей и будущей стоимости денежных средств с учетом фактора риска.
7. Концепция адаптивного динамического управления рисками.

Рекомендуемые источники информации (№ источника)			
Основная	Дополнительная	Методическая	Интернет-ресурсы
1	1	1-2	1-7

Практическое занятие №4 . Методы оценки предпринимательских рисков

Цель данного практического занятия – основные принципы и приемы стратегии риск - менеджмента и их действие

В результате освоения темы обучающийся должен:

Код компетенции ИД-4 ПК – 5; ИД-2 ПК - 6

выполняет необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывать их и представлять результаты и обзоры

осуществляет подготовку предложений по инвестиционным проектам в соответствии с критериями их рыночной привлекательности, целями и критериями отбора

проводит оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта

Теоретическая часть:

Реализация всех видов предпринимательской деятельности плотно связана с возникновением разнообразных неблагоприятных ситуаций, оказывающих негативное влияние на деятельность предприятия. Такие ситуации называются «предпринимательскими рисками». Предпринимательские риски являются неотъемлемой деталью любого бизнеса, избежать их невозможно, однако, понимая причины их возникновения и пути выхода из рискованных ситуаций, риски можно минимизировать.

В условиях турбулентности экономики оценка предпринимательских рисков является важным звеном, определяющим эффективность деятельности любого коммерческого предприятия. Всегда существует вероятность потерь, что впоследствии негативным образом отразится на финансовой устойчивости и ликвидности предприятия. Несмотря на обилие научной литературы, практического руководства и даже регуляторов, тема риска является, вероятно, одной из самых запутанных в отношении соответствующей терминологии, интерпретации того или иного вида риска, порядка его оценки. В литературе не только терминологический разнобой и логически неупорядоченную совокупность различных видов риска, но и большое количество его классификаций, которые, как правило, обособлены бессистемно. Основная проблема касается измеряемости риска. Нетрудно идентифицировать рисковую ситуацию, пояснить её специфичность, гораздо труднее дать методику оценки.

Вопросы для обсуждения на практических занятиях:

1. Оценка вероятности неблагоприятных событий.
2. Общеметодические подходы к количественной оценке риска.
3. Количественные оценки риска и методы их определения.
4. Шкалы риска и характеристика их градаций.
5. Рекомендуемые источники информации для количественной оценки риска.

ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ Сертификат: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6 Владелец: Шебзухова Татьяна Александровна Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022		Рекомендуемые источники информации (№ источника)
--	--	--

Основная	Дополнительная	Методическая	Интернет-ресурсы
1	1	1-2	1-7

Практическое занятие №5. Интегральная оценка риска

Цель данного практического занятия – изучить особенности организации системы управления кредитными рисками

В результате освоения темы обучающийся должен:

Код компетенции ИД-4 ПК – 5; ИД-2 ПК - 6

выполняет необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывать их и представлять результаты и обзоры

осуществляет подготовку предложений по инвестиционным проектам в соответствии с критериями их рыночной привлекательности, целями и критериями отбора

проводит оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта

Теоретическая часть:

Метод расчета интегральной оценки риска – один из самых информативных с точки зрения степени достоверности источников относительно рисков предпринимательской деятельности.

Интегральный показатель риска рассчитывается на основе данных бухгалтерской отчетности. Деятельность любой предпринимательской структуры подвержена, как правило, нескольким основным видам риска: Имущественный; Кредитный; Рыночный. Эти риски и определяют динамику и уровень предпринимательского риска. Методика расчета содержит ряд показателей, для каждого из которого установлено пороговое значение для высокого, среднего и низкого уровня риска.

Эти пороговые значения получены в результате сопоставления средних данных о ликвидности и рентабельности предприятий различных отраслей хозяйствования. При этом, стоит отметить, что перечисленный в таблице набор показателей не является окончательным, он может включать и другие показатели в зависимости от специфики деятельности конкретной организации. Информация взята с сайта биржи

Вопросы для обсуждения на практических занятиях:

1. Интегральные характеристики риска.
2. Статистические распределения ущерба.
3. Статистическое представление средних и предельных характеристик риска.
4. Роль интегральных показателей риска в финансовом планировании деятельности предприятия.
5. Построение полей риска.

Рекомендуемые источники информации (№ источника)			
Основная	Дополнительная	Методическая	Интернет-ресурсы
1	1	1-2	1-7

Практическое занятие №6 . Категории риска и левирджа и их взаимосвязь

Цель данного практического занятия – изучить особенности операционных рисков, способы их оценки и управления

ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН
ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ

Сертификат: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6

Владелец: Шебзухова Татьяна Александровна

Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022

В результате освоения темы обучающийся должен:

Код компетенции ИД-4 ПК – 5; ИД-2 ПК - 6

выполняет необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывать их и представлять результаты и обзоры

осуществляет подготовку предложений по инвестиционным проектам в соответствии с критериями их рыночной привлекательности, целями и критериями отбора

проводит оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта

Теоретическая часть:

Лeverидж – это сложная система управления активами и пассивами предприятия. Любые предприятия стремятся к достижению двух основных целей своей деятельности, т.е.:

увеличению прибыли;

увеличению стоимости самого предприятия.

В этих условиях лeverидж становится тем самым инструментом, который позволяет достичь данные цели, посредством влияний на изменения соотношений и рентабельности собственного и заемного капитала.

Лeverидж делится на три основных вида:

финансовый;

оперативный (производственный);

финансово-оперативный (производственный).

Создание и функционирование любой коммерческой организации упрощенно представляют собой процесс инвестирования финансовых ресурсов на долгосрочной основе с целью извлечения прибыли. Текущая деятельность сопряжена с риском, в частности производственным и финансовым, который следует принимать во внимание в зависимости оттого, с какой позиции характеризуется компания. Как легко видеть из баланса, эта характеристика может быть выполнена либо с позиции активов, которыми владеет и распоряжается предприятие, либо с позиции источников средств. В первом случае возникает понятие производственного риска, во втором – финансового риска.

Вопросы для обсуждения на практических занятиях:

1. Сущность, виды и классификация предпринимательских рисков.
2. Основные методы управления предпринимательскими рисками.
3. Лeverидж и его роль в финансовом менеджменте.
4. Производственный и финансовый лeverидж.
5. Метод расчета критического объема продаж.

Рекомендуемые источники информации (№ источника)			
Основная	Дополнительная	Методическая	Интернет-ресурсы
1	1	1-2	1-7

Практическое занятие №7 . Учет риска при принятии управленческих решений

Цель данного практического занятия – изучить виды и особенности управления рыночными рисками

В результате освоения темы обучающийся должен:

Код компетенции ИД-4 ПК – 5; ИД-2 ПК - 6

выполняет необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывать их и представлять результаты и обзоры

ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ	
Сертификат:	12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6
Владелец:	Шебзухова Татьяна Александровна
Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022	

осуществляет подготовку предложений по инвестиционным проектам в соответствии с критериями их рыночной привлекательности, целями и критериями отбора
проводит оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта

Вопросы для обсуждения на практических занятиях:

1. Современные тенденции в управлении рисками.
2. Принятие решений в условиях риска.
3. Принятие решений в условиях неопределенности.
4. Общая схема управления рисками на предприятии.
5. Программа управления рисками.
6. Разработка ситуационных планов.

Рекомендуемые источники информации (№ источника)			
Основная	Дополнительная	Методическая	Интернет-ресурсы
1	1	1-2	1-7

Практическое занятие №8 . Финансирование риска

Цель данного практического занятия – изучить особенности управления финансовыми рисками компании

В результате освоения темы обучающийся должен:

Код компетенции ИД-4 ПК – 5; ИД-2 ПК - 6

Знать:

выполняет необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывать их и представлять результаты и обзоры

осуществляет подготовку предложений по инвестиционным проектам в соответствии с критериями их рыночной привлекательности, целями и критериями отбора
проводит оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта

Вопросы для обсуждения на практических занятиях:

1. Затраты на риск.
2. Источники финансирования рисков.
3. Текущее, дособытийное и послесобытийное финансирование предпринимательских рисков.
4. Структура затрат при различных методах управления рисками.
5. Финансирование рисков и анализ эффективности методов управления им..

Рекомендуемые источники информации (№ источника)			
Основная	Дополнительная	Методическая	Интернет-ресурсы
1	1	1-2	1-7

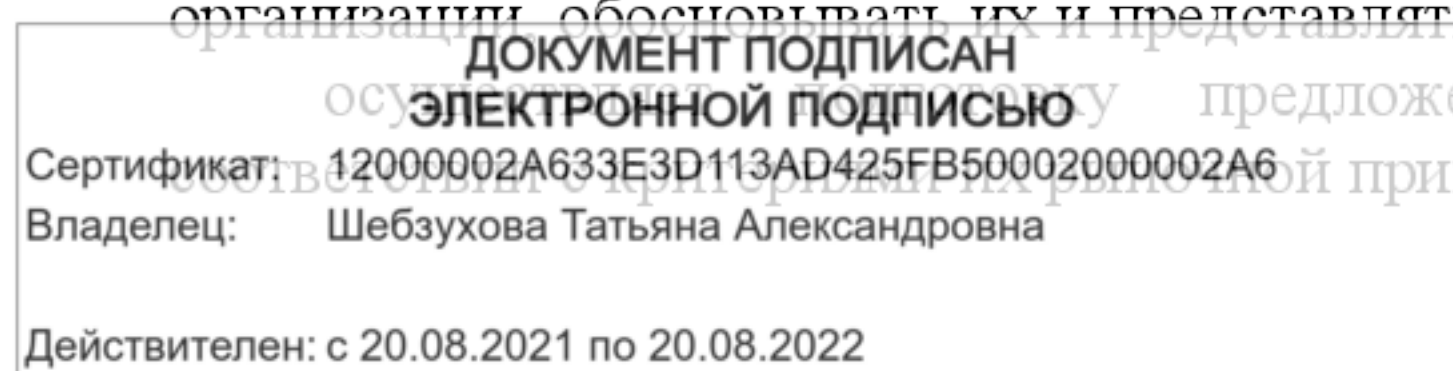
Практическое занятие №9 . Пути снижения предпринимательских рисков

Цель данного практического занятия – изучить особенности страхования, как один из методов управления риском

Код компетенции ИД-4 ПК – 5; ИД-2 ПК - 6

выполняет необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывать их и представлять результаты и обзоры

осуществляет подготовку предложений по инвестиционным проектам в соответствии с критериями их рыночной привлекательности, целями и критериями отбора



проводит оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта

Вопросы для обсуждения на практических занятиях:

1. Стратегические направления снижения предпринимательских рисков.
2. Методы снижения предпринимательских рисков и их характеристика.
3. Выбор оптимального метода снижения рисков.
4. Страхование и самострахование предпринимательских рисков.
5. Формирование фонда риска.

Рекомендуемые источники информации (№ источника)			
Основная	Дополнительная	Методическая	Интернет-ресурсы
1	1	1-2	1-7

Практическое занятие №10 . Разработка программы управления финансовыми рисками организации

Цель данного практического занятия – изучить теоретические и методологические основы риск-менеджмента

В результате освоения темы обучающийся должен:

Код компетенции ИД-4 ПК – 5; ИД-2 ПК - 6

выполняет необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывать их и представлять результаты и обзоры

осуществляет подготовку предложений по инвестиционным проектам в соответствии с критериями их рыночной привлекательности, целями и критериями отбора

проводит оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта

Вопросы для обсуждения на практических занятиях:

1. Общие подходы к формированию программы управления рисками на предприятии.
2. Этапы разработки программы управления рисками.
3. Оценка эффективности текущего управления рисками

Рекомендуемые источники информации (№ источника)			
Основная	Дополнительная	Методическая	Интернет-ресурсы
1	1	1-2	1-7

Практическое занятие №11. Финансирование программы управления риском.

Цель данного практического занятия – изучить теоретические и методологические основы риск-менеджмента

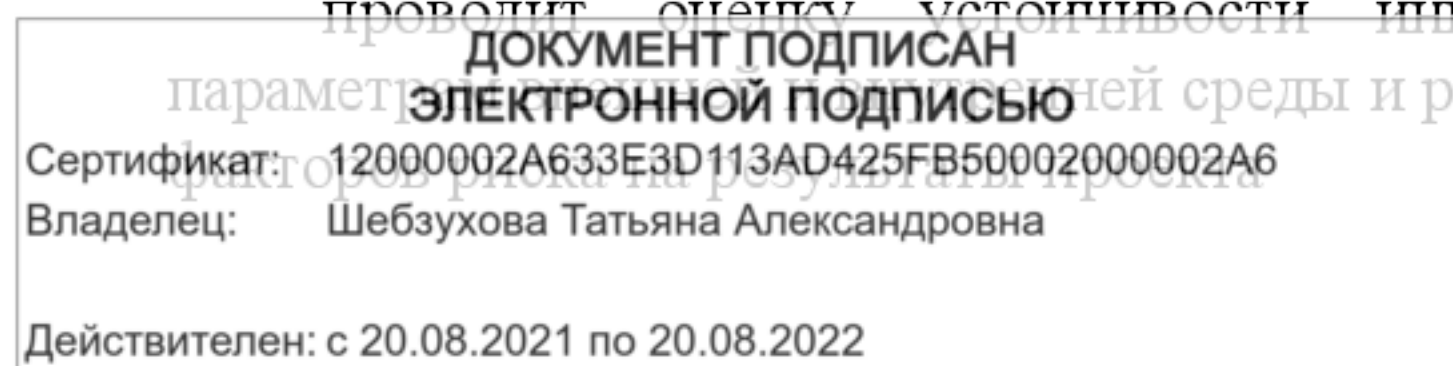
В результате освоения темы обучающийся должен:

Код компетенции ИД-4 ПК – 5; ИД-2 ПК - 6

выполняет необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывать их и представлять результаты и обзоры

осуществляет подготовку предложений по инвестиционным проектам в соответствии с критериями их рыночной привлекательности, целями и критериями отбора

проводит оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта



Вопросы для обсуждения на практических занятиях:

1. Затраты на финансирование программы управления рисками.
2. Источники финансирования программы.
3. Текущее, дособытийное и послесобытийное финансирование программы управления рисками.

Рекомендуемые источники информации (№ источника)			
Основная	Дополнительная	Методическая	Интернет-ресурсы
1	1	1-2	1-7

Практическое занятие №12. Валютный риск

В результате освоения темы обучающийся должен:

Код компетенции ИД-4 ПК – 5; ИД-2 ПК - 6

выполняет необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывать их и представлять результаты и обзоры

осуществляет подготовку предложений по инвестиционным проектам в соответствии с критериями их рыночной привлекательности, целями и критериями отбора

проводит оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта

Вопросы для обсуждения на практических занятиях:

1. Экономический валютный риск.
2. Скрытые риски.
3. Общая характеристика странового валютного риска и способы определения его величины.
4. Определение и классификация валютных рисков.
5. Операционный валютный риск.
6. Трансляционный валютный риск.

Рекомендуемые источники информации (№ источника)			
Основная	Дополнительная	Методическая	Интернет-ресурсы
1	1	1-2	1-7

Практическое занятие №13. Кредитный риск

Вопросы для обсуждения на практических занятиях:

1. Сущность и классификация кредитных рисков.
2. Идентификация кредитных рисков.
3. Методы оценки кредитных рисков.
4. Анализ кредитных рисков и показатели, применяемые для оценки.
5. Управление кредитными рисками.
6. Оптимальное соотношение риска и доходности.

Рекомендуемые источники информации (№ источника)			
Основная	Дополнительная	Методическая	Интернет-ресурсы
1	1	1-2	1-7

Практическое занятие №14. Депозитный риск

Цель занятия – изучить особенности организации

Сертификат:	12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6
Владелец:	Шебзухова Татьяна Александровна
Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022	

В результате освоения темы обучающийся должен:

Код компетенции ИД-4 ПК – 5; ИД-2 ПК - 6

выполняет необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывать их и представлять результаты и обзоры

осуществляет подготовку предложений по инвестиционным проектам в соответствии с критериями их рыночной привлекательности, целями и критериями отбора

проводит оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта

Вопросы для обсуждения на практических занятиях:

1. Теоретические основы депозита и риска.
2. Виды депозитов.
3. Теоретические аспекты депозитного риска.
4. Факторы и формы проявления депозитного риска.
5. Управление привлеченными средствами

Рекомендуемые источники информации (№ источника)			
Основная	Дополнительная	Методическая	Интернет-ресурсы
1	1	1-2	1-7

Практическое занятие №15 Инвестиционный риск

Цель данного практического занятия – изучить особенности операционных рисков, способы их оценки и управления

В результате освоения темы обучающийся должен:

Код компетенции ИД-4 ПК – 5; ИД-2 ПК - 6

выполняет необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывать их и представлять результаты и обзоры

осуществляет подготовку предложений по инвестиционным проектам в соответствии с критериями их рыночной привлекательности, целями и критериями отбора

проводит оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта

Вопросы для обсуждения на практических занятиях:

1. Понятие инвестиционного риска.
2. Виды инвестиционных рисков.
3. Классификация инвестиционных рисков по сферам проявления; по формам инвестирования; по формам инвестирования.
4. Качественный анализ риска.
5. Количественный анализ риска.

Рекомендуемые источники информации (№ источника)			
Основная	Дополнительная	Методическая	Интернет-ресурсы
1	1	1-2	1-7

Практическое занятие №16. Инновационный риск

Цель данного практического занятия – изучить виды и особенности управления

ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН
ЦЕЛЬ ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ

Сертификат: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6
Владелец: Шебзухова Татьяна Александровна

Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022

В результате освоения темы обучающийся должен:

Код компетенции ИД-4 ПК – 5; ИД-2 ПК - 6

Знать:

выполняет необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывать их и представлять результаты и обзоры

осуществляет подготовку предложений по инвестиционным проектам в соответствии с критериями их рыночной привлекательности, целями и критериями отбора
проводит оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта

Вопросы для обсуждения на практических занятиях:

1. Инновационная деятельность.
2. Риски инновационной деятельности.
3. Виды инновационных рисков.
4. Методы оценки рисков в инновационной деятельности.
5. Управление рисками в инновационной деятельности.

Рекомендуемые источники информации (№ источника)			
Основная	Дополнительная	Методическая	Интернет-ресурсы
1	1	1-2	1-7

Практическое занятие №17. Инфляционный риск

Цель данного практического занятия – изучить особенности управления финансовыми рисками компании

В результате освоения темы обучающийся должен:

Код компетенции ИД-4 ПК – 5; ИД-2 ПК - 6

выполняет необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывать их и представлять результаты и обзоры

осуществляет подготовку предложений по инвестиционным проектам в соответствии с критериями их рыночной привлекательности, целями и критериями отбора
проводит оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта

Вопросы для обсуждения на практических занятиях:

1. Понятие и виды инфляции.
2. Темп инфляции.
3. Индекс инфляции.
4. Реальная процентная ставка с учетом инфляции.
5. Понятие и сущность инфляционного риска.
6. Экономические и социальные последствия инфляционного риска.

Рекомендуемые источники информации (№ источника)			
Основная	Дополнительная	Методическая	Интернет-ресурсы
1	1	1-2	1-7

Практическое занятие №18. Налоговый риск

Цель данного практического занятия – изучить особенности страхования, как один

ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН
ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ
Сертификат: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6
Владелец: Шебзухова Татьяна Александровна
Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022

В результате освоения темы обучающийся должен:

Код компетенции ИД-4 ПК – 5; ИД-2 ПК - 6

выполняет необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывать их и представлять результаты и обзоры

осуществляет подготовку предложений по инвестиционным проектам в соответствии с критериями их рыночной привлекательности, целями и критериями отбора

проводит оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта

Вопросы для обсуждения на практических занятиях:

1. Понятие и виды налоговых рисков.
2. Методы оценки налогового риска.
3. Методы налогового риск-менеджмента.
4. Диверсификация риска.
5. Лимитирование сумм сделок.
6. Создание систем внутреннего мониторинга процессов, связанных с рисками.
7. Формализация налоговых процессов внутри компании.
8. Налоговый консалтинг.

Рекомендуемые источники информации (№ источника)			
Основная	Дополнительная	Методическая	Интернет-ресурсы
1	1	1-2	1-7

Критерии оценивания компетенций

Оценка **«отлично»** выставляется студенту, если он свободно справляется с задачами, вопросами и другими видами применения знаний; использует в ответе дополнительный материал все предусмотренные программой задания выполнены, качество их выполнения оценено числом баллов, близким к максимальному; анализирует полученные результаты; проявляет самостоятельность при выполнении заданий.

Оценка **«хорошо»** выставляется студенту, если необходимые практические компетенции в основном сформированы, все предусмотренные программой обучения учебные задания выполнены, качество их выполнения достаточно высокое. Студент твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей.

Оценка **«удовлетворительно»** выставляется студенту, большинство предусмотренных программой заданий выполнено, но в них имеются ошибки, при ответе на поставленный вопрос студент допускает неточности, недостаточно правильные формулировки, наблюдаются нарушения логической последовательности в изложении программного материала.

Оценка **«неудовлетворительно»** выставляется студенту, если он не проявляет значительной активности в собеседовании, допускает существенные ошибки, неуверенно, с большими затруднениями участвует в собеседовании, необходимые практические компетенции не сформированы, большинство предусмотренных программой обучения учебных заданий не выполнено, качество их выполнения оценено числом баллов, близким к минимальному.

Процедура проведения данного оценочного мероприятия включает в себя оценку текущей работы студента и его активности в течение всего курса.

Презентация студента по заданиям позволяют проверить ПК-5 компетенции.

Сертификат: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6
Владелец: Шебзухова Татьяна Александровна
Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022

приведенные вопросы, владеть нормативной базой по указанным направлениям.

При подготовке к ответу студенту предоставляется право пользования нормативно-справочной литературой.

При проверке задания, оцениваются содержательность ответов и активность студента при проведении лекции-дискуссии.

СПИСОК РЕКОМЕНДУЕМОЙ ЛИТЕРАТУРЫ

Основная литература:

Бондаренко, О. Г. Управление коммерческим риском : учебное пособие для бакалавров / О. Г. Бондаренко, В. Т. Гришина. — Москва : Дашков и К, 2018. — 148 с. — ISBN 978-5-394-02935-6. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/85472.html>

2. Ларионова, И. А. Управление финансовыми рисками: практикум / И. А. Ларионова. — Москва : Издательский Дом МИСиС, 2020. — 54 с. — ISBN 2227-8397. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/106892.html>

Дополнительная литература:

1. Салихова, И. С. Инновации в управлении корпоративными знаниями : учебное пособие / И. С. Салихова. — 3-е изд. — Москва : Дашков и К, 2021. — 136 с. — ISBN 978-5-394-04162-4. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/107785.html>

2. Балдин, К. В. Управление рисками : учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальностям экономики и управления (060000) / К. В. Балдин, С. Н. Воробьев. — Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2017. — 511 с. — ISBN 5-238-00861-9. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/71229.html>

Интернет-ресурсы:

1. <http://www.consultant.ru/cons/cgi/online>. - некоммерческая интернет-версия КонсультантПлюс.
2. <https://www.garant.ru/> - информационно-правовой портал Гарант.ру.
3. <https://www.gks.ru/> - официальный сайт Федеральной службы государственной статистики.
4. <https://stavstat.gks.ru/> - Управление Федеральной службы государственной статистики по Северо-Кавказскому федеральному округу.
5. <https://www.minfin.ru/ru/> - официальный сайт Министерства финансов РФ
6. ЭБС «Университетская библиотека онлайн» - <http://biblioclub.ru>
7. Научная электронная библиотека e-library – www.elibrary.ru

**ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН
ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ**

Сертификат: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6

Владелец: Шебзухова Татьяна Александровна

Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ И РОССИЙСКОЙ
ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ АВТОНОМНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«СЕВЕРО-КАВКАЗСКИЙ ФЕДЕРАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»
ПЯТИГОРСКИЙ ИНСТИТУТ (ФИЛИАЛ) СКФУ

Методические указания по выполнению самостоятельной работы
по дисциплине «Управление корпоративными рисками»
для студентов направления подготовки: 38.03.01 Экономика
Направленность (профиль): «Корпоративная экономика и финансы»

ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ		Пятигорск 2022
Сертификат:	12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6	
Владелец:	Шебзухова Татьяна Александровна	
Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022		

СОДЕРЖАНИЕ

	С.
1 Введение	3
2 Общая характеристика самостоятельной работы студента при изучении дисциплины	3
3 План-график выполнения самостоятельной работы	4
4 Методические указания по изучению теоретического материала	5
5 Методические указания по подготовке сообщения к круглому столу	5
6 Вопросы для собеседования	6
7 Список рекомендуемой литературы	11

**ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН
ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ**

Сертификат: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6

Владелец: Шебзухова Татьяна Александровна

Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022

1. Введение

Цель курса – формирование теоретических знаний у студентов в области управления рисками, разработка методов для достижения этой цели, разработка и выбор критериев для принятия правильных финансовых решений, а также практическое использование этих критериев с учетом индивидуальных условий деятельности предприятия.

Успешное овладение дисциплиной позволит применить полученные знания в практической деятельности в качестве финансового менеджера, риск-менеджера в финансово-экономических подразделениях, экономиста по планированию, экономиста по финансовой работе, коммерческого агента, преподавателя высшей школы, финансового аналитика, консультанта по экономическим вопросам, научного сотрудника в области предпринимательских рисков.

Задачи дисциплины:

- формирование целостной системы знаний о содержании, принципах и инструментах управления предпринимательскими рисками хозяйствующего субъекта;
- изучение системы современных методов финансового управления;
- рассмотрение новой финансовой идеологии хозяйствования, адекватной рыночной экономике;
- ознакомление с современными финансовыми инструментами, используемыми в риск - менеджменте.

Бакалавр, успешно освоивший дисциплину, должен знать теоретические и методические основы управления рисками; концептуальные основы рисков; основы оптимизация уровня доходности и риска финансовых операций; этапы управления разработки программы управления рисками финансовых институтов и т.д.

Студент должен уметь ориентироваться в проблемах управления рисками в условиях современной экономики РФ.

Дисциплина «Управление корпоративными рисками» является дисциплиной относится к вариативной части блока дисциплин базового цикла. Ее освоение происходит в 7 семестре.

2. Общая характеристика самостоятельной работы студента при изучении дисциплины

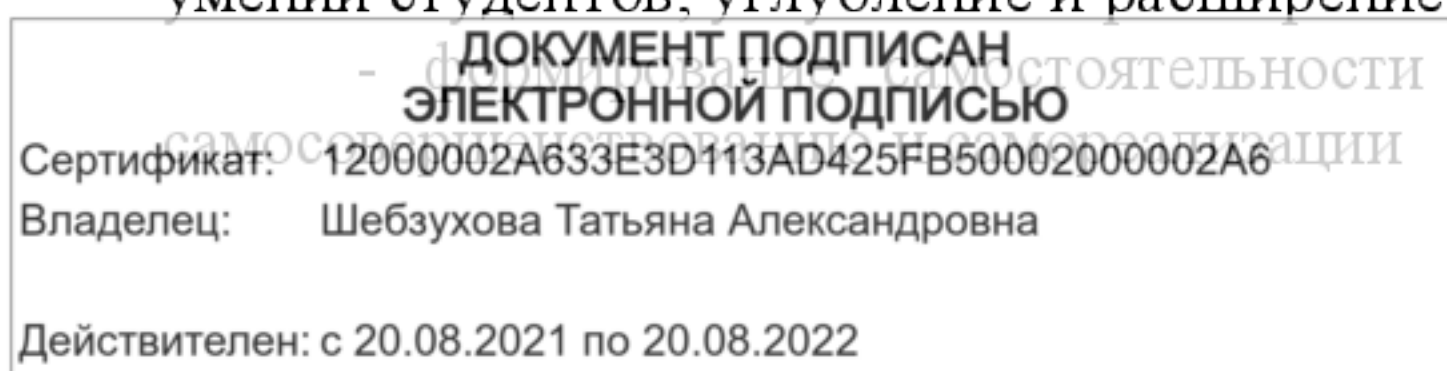
Самостоятельная работа студентов по дисциплине «Управление корпоративными рисками» предусматривает следующие виды: самостоятельное изучение литературы; выполнение контрольной работы.

Цели самостоятельной работы:

- овладение новыми знаниями, а также методами их получения;
- развитие умения приобретения научных знаний путем личного поиска и переработки информации;
- сбор и систематизация знаний по конкретной теме или проблеме

Задачи самостоятельной работы:

- формирование умений использовать справочную документацию и специальную литературу; развитие познавательных способностей и активности студентов: творческой инициативы, самостоятельности, ответственности и организованности.
- систематизация и закрепление полученных теоретических знаний и практических умений студентов; углубление и расширение теоретических знаний;
- формирование самостоятельности мышления, способностей к саморазвитию,



- развитие исследовательских умений.

Цель самостоятельного изучения литературы – самостоятельное овладение знаниями, опытом исследовательской деятельности.

Задачами самостоятельного изучения литературы являются:

- углубление и расширение теоретических знаний;
- формирование умений использовать нормативную, правовую, справочную документацию и специальную литературу;
- развитие познавательных способностей и активности студентов.

Целью самостоятельного выполнения контрольной работы по дисциплине является овладение фундаментальными знаниями, профессиональными умениями и навыками деятельности по профилю, опытом творческой, исследовательской деятельности.

Задачами данного вида самостоятельной работы студента являются:

- систематизация и закрепление полученных теоретических знаний и практических умений студентов;
- углубление и расширение теоретических знаний;
- формирование умений использовать нормативную, правовую, справочную документацию и специальную литературу;
- развитие познавательных способностей и активности студентов: творческой инициативы, самостоятельности, ответственности и организованности;
- формирование самостоятельности мышления, способностей к саморазвитию, самосовершенствованию и самореализации;
- развитие исследовательских умений.

Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесённых с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Код, формулировка компетенции	Код, формулировка индикатора	Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю), характеризующие этапы формирования компетенций, индикаторов
ПК-5 Способность составлять финансовые планы, бюджеты, разрабатывать инвестиционные проекты	ИД-4 ПК - 5 способность проводить оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта	выполняет необходимые расчеты по планированию и бюджетированию в организации, обосновывает их и представляет результаты и обзоры осуществляет подготовку предложений по инвестиционным проектам в соответствии с критериями их рыночной привлекательности, целями и критериями отбора проводит оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся параметрам внешней и внутренней среды и разрабатывать меры по снижению воздействия факторов риска на результаты проекта

ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН
ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ
Сертификат: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6
Владелец: Шебзухова Татьяна Александровна
Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022

3. План-график выполнения самостоятельной работы

Коды реализуемых компетенций, индикатора(ов)	Вид деятельности студентов	Средства и технологии оценки	Объем часов, в том числе		
			СРС	Контактная работа с преподавателем	Всего
6 семестр					
ИД-1 ПК - 5	Вопросы для собеседования	Собеседование	77,85	8,65	86,5
ИД-1 ПК - 5	Подготовка сообщения к круглому столу	Собеседование	18	2	20
Итого за 6 семестр			95,85	10,65	106,5
Итого			95,85	10,65	106,5

4. Методические указания по изучению теоретического материала

4.1. Рекомендации по организации работы с литературой

При работе с книгой необходимо подобрать литературу, научиться правильно ее читать, вести записи. Для подбора литературы в библиотеке используются алфавитный и систематический каталоги.

Правильный подбор учебников рекомендуется преподавателем, читающим лекционный курс. Необходимая литература может быть также указана в методических разработках по данной дисциплине.

Изучая материал по учебнику, следует переходить к следующему вопросу только после правильного уяснения предыдущего.

Особое внимание следует обратить на определение основных понятий дисциплины. Студент должен подробно разбирать примеры, которые поясняют такие определения, и уметь строить аналогичные примеры самостоятельно. Нужно добиваться точного представления о том, что изучаешь. Полезно составлять опорные конспекты. При изучении материала по учебнику полезно в тетради (на специально отведенных полях) дополнять конспект лекций. Там же следует отмечать вопросы, выделенные студентом для консультации с преподавателем.

Различают два вида чтения; первичное и вторичное. *Первичное* - это внимательное, неторопливое чтение, при котором можно остановиться на трудных местах. После него не должно остаться ни одного непонятого слова. Содержание не всегда может быть понятно после первичного чтения.

Задача *вторичного* чтения - полное усвоение смысла целого (по счету это чтение может быть и не вторым, а третьим или четвертым).

Самостоятельная работа с учебниками и книгами (а также самостоятельное изучение теоретического материала, обозначенных преподавателем на лекциях) – это

важнейшее условие формирования у себя научного способа познания. Основные советы здесь можно свести к следующим:

- составить перечень книг, с которыми следует познакомиться;
- перечень должен быть систематизированным (что необходимо для семинаров, что для экзаменов, что пригодится для написания курсовых и дипломных работ).
- обязательно выписывать все выходные данные по каждой книге (при написании курсовых и дипломных работ это позволит очень сэкономить время).
- разобраться для себя, какие книги (или какие главы книг) следует прочитать более внимательно, а какие – просто просмотреть.
- при составлении перечней литературы следует посоветоваться с преподавателями и научными руководителями, которые помогут лучше сориентироваться.
- все прочитанные книги, учебники и статьи следует конспектировать, но это не означает, что надо конспектировать «все подряд»: можно выписывать кратко основные идеи автора и иногда приводить наиболее яркие и показательные цитаты.
- в работе с научной литературой следует выработать в себе способность «воспринимать» сложные тексты; для этого лучший прием – научиться «читать медленно», когда понятно каждое прочитанное слово (а если слово незнакомое, то либо с помощью словаря, либо с помощью преподавателя обязательно его узнать).

5. Методические указания по подготовке сообщения к круглому столу

Круглый стол проводится с целью диагностики уровня закрепления новых знаний, оценки коммуникативных компетенций, умения приводить аргументы и контраргументы, формирование навыков публичного выступления. При диагностике результатов основными критериями являются:

- демонстрация предварительной информационной готовности к обсуждению;
- выступление с проблемным вопросом;
- аргументация ответов на вопросы оппонентов;
- формулировка критических замечаний и вопросов к выступающему.

Тема 3. Концепции и методический инструментарий риск - менеджмента

Тема 6. Категории риска и левеиджа и их взаимосвязь

Тема 8. Финансирование риска

Тема 9. Пути снижения предпринимательских рисков

Критерии оценивания компетенций

Оценка **«отлично»** выставляется студенту, если в процессе проведения круглого стола он показывает исчерпывающе знания, последовательно, четко и логически стройно излагает материал; использует в ответе дополнительный материал; анализирует полученные результаты; проявляет самостоятельность при выполнении заданий.

Оценка **«хорошо»** выставляется студенту, если он твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос.

Оценка **«удовлетворительно»** выставляется студенту, если при ответе на поставленный вопрос студент допускает неточности, недостаточно правильные формулировки, наблюдаются нарушения логической последовательности в изложении программного материала.

Оценка **«неудовлетворительно»** выставляется студенту, если он допускает существенные ошибки, необходимые практические компетенции не сформированы.

6. Вопросы для собеседования

ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ		6 семестр
Сертификат:	12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6	Базовый уровень
Владелец:	Шебзухова Татьяна Александровна	
Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022		

Тема 1. Теоретические основы риск – менеджмента

6. Содержание риск - менеджмента и его место в системе управления организацией.
7. Понятие риска, его основные элементы и черты.
8. Общие принципы классификации рисков.

Тема 2. Анализ рисков основных видов экономической деятельности

7. Характеристика предпринимательской экономической деятельности.
8. Риски производственной деятельности.
9. Коммерческие и посреднические риски.

Тема 3. Концепции и методический инструментарий риск - менеджмента

8. Базовые концепции управления рисками.
9. Финансовые и коммерческие вычисления в исторической ретроспективе.
10. Понятие риска и доходности финансовой операции и их взаимосвязь.
11. Безрисковая норма доходности.

Тема 4. Методы оценки предпринимательских рисков

6. Оценка вероятности неблагоприятных событий.
7. Общеметодические подходы к количественной оценке риска.
8. Количественные оценки риска и методы их определения.
9. Шкалы риска и характеристика их градаций.
10. Показатели, применяемые для количественной оценки риска.

Тема 5. Интегральная оценка риска

6. Интегральные характеристики риска.
7. Статистические распределения ущерба.
8. Статистическое представление средних и предельных характеристик риска.

Тема 6. Категории риска и левириджа и их взаимосвязь

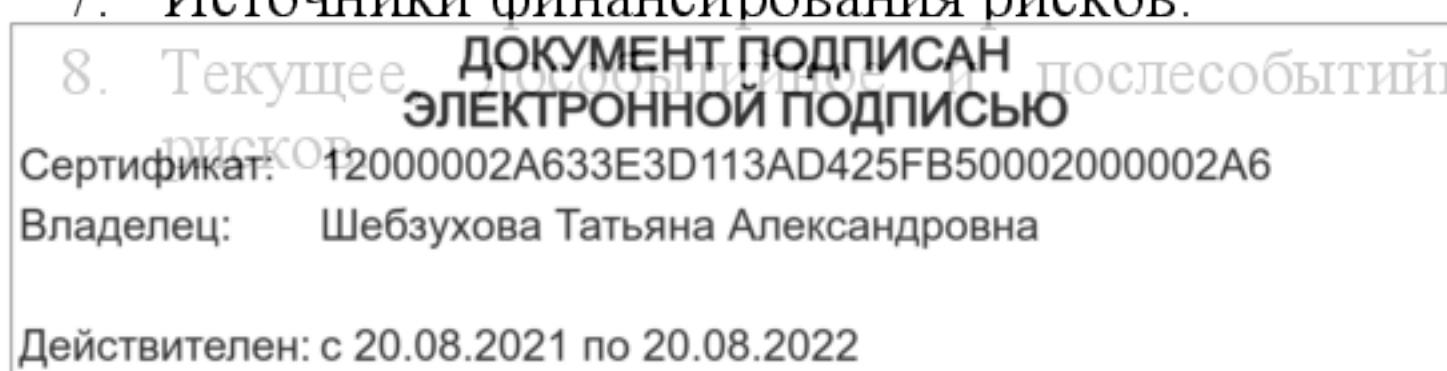
6. Сущность, виды и классификация предпринимательских рисков.
7. Основные методы управления предпринимательскими рисками.
8. Левиридж и его роль в финансовом менеджменте.
9. Производственный и финансовый левиридж.
10. Метод расчета критического объема продаж.

Тема 7. Учет риска при принятии управленческих решений

7. Современные тенденции в управлении рисками.
8. Принятие решений в условиях риска.
9. Принятие решений в условиях неопределенности.
10. Общая схема управления рисками на предприятии.
11. Программа управления рисками.
12. Разработка ситуационных планов.

Тема 8. Финансирование риска

6. Затраты на риск.
7. Источники финансирования рисков.
8. Текущее финансирование рисков. Постсобытийное финансирование предпринимательских рисков.



Тема 9. Пути снижения предпринимательских рисков

6. Стратегические направления снижения предпринимательских рисков.
7. Методы снижения предпринимательских рисков и их характеристика.
8. Выбор оптимального метода снижения рисков.
9. Страхование и самострахование предпринимательских рисков.
10. Формирование фонда риска.

Тема 10. Разработка программы управления финансовыми рисками организации

4. Общие подходы к формированию программы управления рисками на предприятии.
5. Этапы разработки программы управления рисками.

Тема 11. Финансирование программы управления риском

4. Затраты на финансирование программы управления рисками.
5. Источники финансирования программы.
6. Текущее, дособытийное и послесобытийное финансирование программы управления рисками.

Тема 12. Валютный риск

1. Экономический валютный риск.
2. Скрытые риски.
3. Общая характеристика странового валютного риска и способы определения его величины.

Тема 13. Кредитный риск

7. Сущность и классификация кредитных рисков.
8. Идентификация кредитных рисков.
9. Методы оценки кредитных рисков.

Тема 14. Депозитный риск

6. Теоретические основы депозита и риска.
7. Виды депозитов.
8. Теоретические аспекты депозитного риска.

Тема 15. Инвестиционный риск

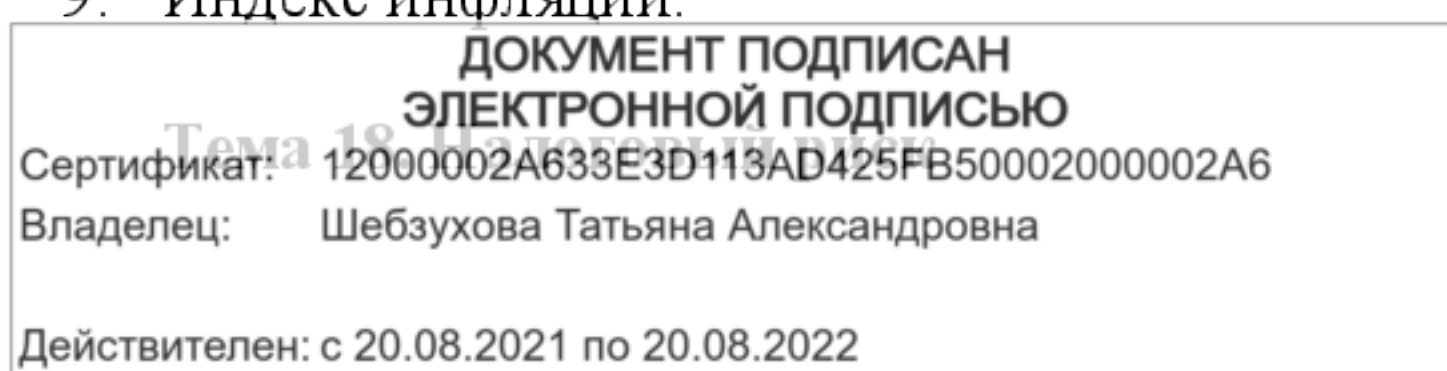
6. Понятие инвестиционного риска.
7. Виды инвестиционных рисков.
8. Классификация инвестиционных рисков по сферам проявления; по формам инвестирования; по формам инвестирования.

Тема 16. Инновационный риск

1. Инновационная деятельность.
2. Риски инновационной деятельности.
3. Виды инновационных рисков.

Тема 17. Инфляционный риск

7. Понятие и виды инфляции.
8. Темп инфляции.
9. Индекс инфляции.



9. Понятие и виды налоговых рисков.
10. Методы оценки налогового риска.
11. Методы налогового риск-менеджмента.
12. Диверсификация риска.
13. Лимитирование сумм сделок.

Повышенный уровень

Тема 1. Теоретические основы риск – менеджмента

1. Характеристика рисков в различных сферах предпринимательской деятельности.
2. Причины возникновения экономического риска.

Тема 2. Анализ рисков основных видов экономической деятельности

1. Финансовые риски.
2. Классификация рисков по масштабам, формам и обстоятельствам их проявления.
3. Системная классификация рисков по природе формирующих их факторов.

Тема 3. Концепции и методический инструментальный риск - менеджмента

1. Статистические показатели в риск – менеджменте.
2. Определение настоящей и будущей стоимости денежных средств с учетом фактора риска.
3. Концепция адаптивного динамического управления рисками.

Тема 4. Методы оценки предпринимательских рисков

1. Метод построения деревьев событий.
2. Метод «события - последствия».
3. Метод деревьев отказов.
4. Методы индексов опасности.
5. Оценка ущерба от наступления рискованной ситуации.

Тема 5. Интегральная оценка риска

1. Роль интегральных показателей риска в финансовом планировании деятельности предприятия.
2. Построение полей риска.

Тема 6. Категории риска и левириджа и их взаимосвязь

1. Оценка производственного левириджа.
2. Оценка финансового левириджа.
3. Левиридж и его роль в системе стратегического финансового планирования.
4. Стоимость бизнеса.

Тема 7. Учет риска при принятии управленческих решений

1. Организационная структура службы управления рисками.
2. Методы воздействия на риск.
3. Сравнительная оценка вариантов управленческих решений с учетом риска.
4. Выбор стратегии риск – менеджмента.
5. Финансовые инструменты управления рисками.
6. Учет риска при инвестировании капитальных вложений.

Тема 8. Формирование риска

1. Структура системы управления рисками.

Сертификат: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6
 Владелец: Шебзухова Татьяна Александровна
 Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022

2. Финансирование рисков и анализ эффективности методов управления им..

Тема 9. Пути снижения предпринимательских рисков

1. Преимущества и недостатки самострахования.
2. Кэптивные страховые компании.
3. Оценка эффективности методов управления рисками.
4. Анализ экономической эффективности страхования и самострахования.

Тема 10. Разработка программы управления финансовыми рисками организации

1. Оценка эффективности текущего управления рисками

Тема 11. Финансирование программы управления риском

1. Структура затрат при различных способах финансирования рисков.
2. Финансирование программы и анализ ее эффективности.

Тема 12. Валютный риск

1. Определение и классификация валютных рисков.
2. Операционный валютный риск.
3. Трансляционный валютный риск.

Тема 13. Кредитный риск

1. Анализ кредитных рисков и показатели, применяемые для оценки.
2. Управление кредитными рисками.
3. Оптимальное соотношение риска и доходности.

Тема 14. Депозитный риск

1. Факторы и формы проявления депозитного риска.
2. Управление привлеченными средствами

Тема 15. Инвестиционный риск

1. Качественный анализ риска.
2. Количественный анализ риска.
3. Механизм оценки инвестиционного риска.
4. Пути снижения инвестиционного риска .

Тема 16. Инновационный риск

1. Методы оценки рисков в инновационной деятельности.
2. Управление рисками в инновационной деятельности.

Тема 17. Инфляционный риск

1. Реальная процентная ставка с учетом инфляции.
2. Понятие и сущность инфляционного риска.
3. Экономические и социальные последствия инфляционного риска.

Тема 18. Налоговый риск

1. Создание систем внутреннего мониторинга процессов, связанных с рисками.
2. Формализация налоговых процессов внутри компании.
3. Налоговый консалтинг.

4. Страхован
5. Самострахование

**ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН
ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ**

Сертификат: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6
Владелец: Шебзухова Татьяна Александровна

Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022

6. Построение системы управления налоговыми рисками организации.

1. Критерии оценивания компетенций*

Оценка «отлично» выставляется, если студент полностью справился с заданием, показал умения и навыки.

Оценка «хорошо» выставляется, если студент полностью справился с заданием, показал умения и навыки, но допустил незначительные ошибки.

Оценка «удовлетворительно» выставляется, если студент полностью справился с теоретическим заданием, но не показал умения и навыки.

Оценка «неудовлетворительно» выставляется, если студент не справился с заданиями.

2. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций

Процедура проведения данного оценочного мероприятия включает в себя оценку текущей работы студента и его активности в течение всего курса.

Предлагаемые студенту задания позволяют проверить ОПК-3, ПК-5 компетенции.

Для подготовки к данному оценочному мероприятию необходимо подготовить ответы на приведенные вопросы, владеть нормативной базой по указанным направлениям.

При подготовке к ответу студенту предоставляется право пользования нормативно-справочной литературой.

При проверке задания, оцениваются содержательность ответов и активность студента при проведении лекции-дискуссии.

7. Список рекомендуемой литературы

Основная литература:

1. Бондаренко, О. Г. Управление коммерческим риском : учебное пособие для бакалавров / О. Г. Бондаренко, В. Т. Гришина. — Москва : Дашков и К, 2018. — 148 с. — ISBN 978-5-394-02935-6. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/85472.html>

2. Ларионова, И. А. Управление финансовыми рисками: практикум / И. А. Ларионова. — Москва : Издательский Дом МИСиС, 2020. — 54 с. — ISBN 2227-8397. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/106892.html>

Дополнительная литература:

1. Салихова, И. С. Инновации в управлении корпоративными знаниями : учебное пособие / И. С. Салихова. — 3-е изд. — Москва : Дашков и К, 2021. — 136 с. — ISBN 978-5-394-04162-4. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/107785.html>

2. Балдин, К. В. Управление рисками : учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальностям экономики и управления (060000) / К. В. Балдин, С. Н. Воробьев. — Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2017. — 511 с. — ISBN 5-238-00861-9. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/71229.html>

Интернет-ресурсы:

1. www.moscow.ru — официальный сайт Правительства Российской Федерации

2. www.moscow.ru — официальный сайт Правительства Российской Федерации

Сертификат: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6

Владелец: Шебзухова Татьяна Александровна

Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022

3. www.cbr.ru – Центральный банк Российской Федерации
4. www.gks.ru – Федеральная служба государственной статистики Российской Федерации

**ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН
ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ**

Сертификат: 12000002A633E3D113AD425FB50002000002A6

Владелец: Шебзухова Татьяна Александровна

Действителен: с 20.08.2021 по 20.08.2022