

**Частное образовательное учреждение высшего образования
«Ростовский институт защиты предпринимателя»
(РИЗП)**

РАССМОТРЕНО И СОГЛАСОВАНО
на заседании кафедры «Маркетинг»
протокол 11 от 26.06.2017 г.
Зав. кафедрой «Маркетинг»



к.э.н., доц. Крамаренко Р.Р.

УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ
по организации самостоятельной работы студентов и проведению
практических (семинарских) занятий
по дисциплине (модулю)

Рис менеджмент

код и наименование направления подготовки (специальности)	42.03.01 Реклама и связи с общественностью
направленность (профиль)	Реклама и связи с общественностью в коммерческой деятельности
Квалификация (степень) выпускника	Бакалавр

**Ростов-на-Дону
2017г.**

Учебно-методические указания по организации самостоятельной работы студентов и проведению практических (семинарских) занятий по дисциплине (модулю) «Риск менеджмент» направлению подготовки 42.03.01 Реклама и связи с общественностью (уровень бакалавриата),

Автор(ы):

К.э.н., доц. Левчук В.В.кафедры «Маркетинг»

(инициалы, фамилия, должность, ученая степень, ученое звание)

Тема 1. Понятие и содержание риск- менеджмента.

Задания для семинарского занятия

1. Понятие, цели и задачи риск-менеджмента.
2. Сущность, содержание основные элементы, причины возникновения риск-менеджмента.
3. Роль и место риск- менеджмента на современном предприятии.
4. Функции, организация и правила риск–менеджмента.
5. Понятие и содержание предпринимательского риска.
6. Объекты и субъекты риска. Общая классификация опасностей.

Задания для самостоятельной работы

1. Роль и место риска, как экономической категории.
2. Основные аспекты и тенденции риск–менеджмента.
3. Источники риска. Виды источников риска.
4. Факторы и причины риска.
5. Возможные причины возникновения рисков.
6. Выявление факторов риска.

Тема 2. Классификация и виды рисков.

Задания для семинарского занятия

1. Классификация рисков.
2. Критерии классификации:
 - по времени возникновения, по факторам возникновения;
 - по характеру учета;
 - по характеру последствий;
 - по сфере возникновения.
3. Краткая характеристика основных видов риска в различных экономической деятельности.
4. Риски неисполнения хозяйственных договоров.

Задания для самостоятельной работы

1. Риски изменения рыночной конъюнктуры и усиления конкуренции.
2. Риски возникновения непредвиденных расходов и снижения доходов.
3. Прочие производственные риски.

Тема 3. Основы теории управления рисками

Задания для семинарского занятия

1. Традиционный и современный подходы к управлению рисками предприятий.
2. Логические и исторические предпосылки создания теории управления риском.
3. Основные положения современного подхода к управлению.
4. Цели и инструменты управления рисками компании.
5. Определение, цели, задачи и общая характеристика системы управления риском.
6. Стратегия управления предпринимательскими рисками.

7. Основные принципы управления риском: избежание, снижение, принятие, отказ.

8. Этапы процесса управления риском: выявление и оценка, сравнение методов воздействия на риск, выбор методов воздействия.

Задания для самостоятельной работы

1. Модели организации управления рисками предприятий в рамках современного подхода
2. Система управления риском.
3. Управление риском как часть общего менеджмента.
4. Служба риск менеджмента.
5. Основные стратегические направления снижения уровня риска.
6. Современные требования к управленческим действиям.
7. Внешние и внутренние факторы риска.

Тема 4. Организация управления рисками

Задания для семинарского занятия

1. Функции управления рисками руководителей высшего звена.
2. Функции управления рисками в деятельности отдельных подразделений организации.
3. Функции специализированного органа управления рисками.
4. Меры риск-менеджмента.
5. Структура и макет программы управления рисками и ее финансирование. Построение программы управления рисками.
6. Способы управления рисками: организационный, финансовый, договорной подходы.

Задания для самостоятельной работы

1. Разработка мер реагирования: избежание, снижение, принятие рисков.
2. Финансовый аспект управления рисками.
3. Выработка и принятия рискованной позиции фирмы. Выработка и принятие решений по стратегии управления рисками.
4. Разработка механизмов минимизации и устранения рисков.
5. Механизм финансирования рисков.
6. Дособытийное и послесобытийное финансирование. Затраты на риск.

Тема 5. Развитие моделей и методов управления рисками.

Задания для семинарского занятия

1. Окружающая рискованная среда организации. Рискованная микросреда организации.
2. Ценности компании, подверженные риску. Типовые риски, которым подвержена организация.
3. Модель управления риском. Основные элементы риск-менеджмента. Краеугольные камни риск-менеджмента.
4. Правила управления рисками.
5. Процесс управления рисками на предприятии.

6. Методы управления рисками. Методы уклонения от риска. Методы локализации и диссипации риска. Методы компенсации риска.

Задания для самостоятельной работы

1. Определение рамок риск-менеджмента.
2. Определение сложности к риску. Создание культуры риск-менеджмента.
3. Методический арсенал диагностики риска. Выгоды риск-менеджмента.
4. Характеристика методов трансформации и финансирования рисков.
5. Методы трансформации рисков.
6. Метод снижения частоты ущерба.
7. Метод уменьшения размера убытков.
8. Метод аутсорсинга риска. Метод разделения риска.

Тема 6. Методы выявления и оценки риска.

Задания для семинарского занятия

1. Методы выявления рисков.
2. Сущность и роль оценки риска. Методы диагностики риска.
3. Источники сбора информации для идентификации рисков.
4. Особенности идентификации и картографирования рисков для российских компаний.
5. Методы прогнозирования рисков: метод использования аналогов, статистический метод, метод логических построений, математические методы, экспертный метод, натуральное моделирование. Построение карты рисков.
6. Развитие способов оценки рисков. Ограничение гипотез эффективного рынка.
7. Рыночные и нерыночные риски.
 - Учет рисков в современных портфельных теориях.
 - Механизмы диверсификации и хеджирования рисков.
 - Форвардные и фьючерсные контракты. Опционы.
 - Страхование или хеджирование.

Задания для самостоятельной работы

1. Опросные листы, карты потоков, прямая инспекция, анализ финансовой и управленческой отчетности.
2. Оценка вероятности неблагоприятных событий через построение деревьев событий. Метод индексов опасности.
3. Статистические и вероятностные методы оценки рисков. Дисперсия и вариация как мера риска.
4. Методический арсенал диагностики рисков. Картографирование рисков фирмы.
5. Учет рисков в экономических решениях фирмы.
6. Способы построения портфельных рисков для разных видов субъектов риска.
7. Способы построения карт рисков и матриц принятия рискованных решений.

Тема 7. Типовые решения управления рисками в различных областях.

Задания для семинарского занятия

1. Производственный риск.

- Причины возникновения, структура, сущность, методы управления. -
- Организация управления производственными рисками.
- Риски неисполнения хозяйственных договоров.

2. Финансовый риск.

- Классификация финансовых рисков.
- Причины возникновения, сущность, методы управления.
- Риски ликвидности в финансовых институтах.
- Биржевые риски.
- Процентные риски.
- Управление финансовыми рисками.

3. Инвестиционный риск.

- Риск-менеджмент в разрезе инвестиционной стратегии.
- Закономерности управления инвестиционными проектами, структура инвестиционных рисков, технология учета риска.
- Анализ риска в инвестиционной программе с привлечением кредита.

4. Коммерческий риск. Проблемы возникновения, сущность, методы управления.

5. Страновой риск.

- Понятие странового риска и его структура.
- Проблемы возникновения, сущность, методы управления.
- Политический риск.
- Экономический риск.

6. Валютный риск. Проблемы возникновения, сущность, методы управления в сфере производства и сбыта.

7. Банковские риски.

- Проблемы возникновения, сущность, методы управления.
- Управление банковскими рисками..

8. Организационный риск. Проблемы возникновения, сущность, методы управления.

Задания для самостоятельной работы

1. Производственный риск

- Способы построения портфельных рисков для разных видов субъектов риска.
- Способы построения карт рисков и матриц принятия рискованных решений.

2. Финансовый риск.

- Механизмы управления ликвидностью.
- Рыночные риски.
- Кредитные риски.

3. Инвестиционный риск.

- Управление рисками - составляющая инвестиционной стратегии.
- Принципы снижения инвестиционного риска.
- Проблема количественной оценки риска проекта.

- Проблема и практика страхования инвестиционных рисков.

4.Страновой риск.

-Инвестиционный климат и страновой риск.

-Глобализация и управление транснациональной компанией.

5.Банковские риски.

-Риск не возврата размещенных ресурсов банка.

-Показатели рискованности банка