Министерство просвещения Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Ульяновский государственный педагогический университет
имени И.Н. Ульянова»
(ФГБОУ ВО «УлГПУ им. И.Н. Ульянова»)

Факультет права, экономики и управления
Кафедра теоретических основ экономики и правоведения

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по учебно-методической работе
_____ С.Н. Титов
«29» октября 2021 г.

РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ

Программа учебной дисциплины
Организационно-управленческого модуля
основной профессиональной образовательной программы высшего образования – программы бакалавриата по направлению подготовки
43.03.01 Сервис.
Направленность (профиль) образовательной программы:
Технологии и организация деятельности в индустрии гостеприимства

(заочная форма обучения)

Составитель: Суетин И.Н., к.п.н., доцент кафедры теоретических основ экономики и правоведения

Рассмотрено и одобрено на заседании ученого совета факультета права, экономики и управления, протокол от «11» октября 2021 г. №2

Ульяновск, 2021

ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН
ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ

Сертификат: 01D77C644FC1E54000000006381D0002
Владелец: Титов Сергей Николаевич
Действителен: с 19.07.2021 до 19.07.2022

Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Риск-менеджмент» относится к дисциплинам части, формируемой участниками образовательных отношений Блока 1. Дисциплины (модули) Организационно-управленческого модуля учебного плана основной профессиональной образовательной программы высшего образования – программы бакалавриата по направлению подготовки 43.03.01 Сервис, направленность (профиль) образовательной программы «Технологии и организация деятельности в индустрии гостеприимства», заочной формы обучения.

Дисциплина опирается на результаты обучения, сформированные в рамках изучения следующих дисциплин: «Методы принятия управленческих решений», «Стратегический менеджмент в индустрии гостеприимства» и др.

Результаты изучения дисциплины «Риск-менеджмент» являются теоретической и методологической основой для прохождения преддипломной практики и государственной итоговой аттестации.

1. Перечень планируемых результатов обучения (образовательных результатов) по дисциплине

Целью освоения дисциплины «Риск-менеджмент» является формирование у студентов системы научных и практических знаний о сущности и содержании рисков в современных организациях, а также умений и навыков по идентификации, оценке и управлению различными видами рисков.

Задачей освоения дисциплины является формирование у студентов знаний о понятийно-категориальном аппарате риск-менеджмента, о классификации рисков, об оценке рисков, об управлении рисками и устранении потерь при наступлении рискового события.

В результате освоения программы бакалавриата обучающийся должен овладеть следующими результатами обучения по дисциплине «Риск-менеджмент»:

Компетенция и индикаторы ее достижения в дисциплине	Образовательные результаты дисциплины (этапы формирования дисциплины)		
	знает	умеет	владеет
ПК-5 Способен организовать работу исполнителей. ПК-5.1. Владеет теоретическими знаниями в области организации деятельности персонала. ПК-5.2. Анализирует методы организации деятельности персонала. ПК-5.3. Предлагает оптимальные пути решения управленческих задач в области организации деятельности персонала.	ОР-1 основы взаимодействия с персоналом, управления персоналом	ОР-2 проводить анализ и оценку организации труда персонала	ОР-3 навыками разработки мероприятий, направленных на повышение эффективности организации труда

ПК-6 Способен организовать деятельность предприятия сервиса с учетом изменения конъюнктуры рынка и спроса потребителей, а также социальной политики государства. ПК-6.1. Владеет теоретическими знаниями организации деятельности предприятия сервиса. ПК-6.2. Использует методы организации деятельности предприятия сервиса. ПК-6.3. Участвует в организации деятельности предприятия сервиса с учетом изменения конъюнктуры рынка и спроса потребителей, а также социальной политики государства.	ОР-4 основы функционирования предприятия сервиса, организации деятельности предприятия сервиса	ОР-5 планировать, анализировать деятельность предприятия сервиса, сравнивать полученный результат с планируемым, выявлять причины расхождения панируемого и реального результатов	ОР-6 навыками применения методов организации деятельности предприятия сервиса с учетом изменения конъюнктуры рынка и спроса потребителей, а также социальной политики государства
ПК-8 Способен к организации взаимодействия предприятия сервиса с контактными аудиториями. ПК-8.1. Владеет теоретическими знаниями организации взаимодействия предприятия сервиса с контактными аудиториями. ПК-8.2. Применяет методы организации взаимодействия предприятия сервиса	ОР-7 основы ведения деловых переговоров, осуществления коммуникаций с контактными аудиториями	ОР-8 вести переговоры, осуществлять коммуникации с контактными аудиториями	ОР-9 навыками ведения деловых переговоров

с контактными аудиториями. ПК-8.3. Участвует в деятельности по организации взаимодействия предприятия сервиса с контактными аудиториями.			

2. Объем дисциплины в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся

Номер семестра	Учебные занятия						Форма промежуточной аттестации
	Всего		Лекции, час	Практические занятия, час	Лабораторные занятия, час	Самостоят. работа, час	
	Трудоемк.						
	Зач. ед.	Часы					
9	4	144	4	12	-	119	Экзамен (9)
Итого:	4	144	4	12	-	119	Экзамен (9)

3. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий

3.1. Указание тем (разделов) и отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий

Наименование раздела и тем	Количество часов по формам организации обучения			
	Лекционные занятия	Практические занятия	Лабораторные занятия	Самостоятель-ная работа
9 семестр				
Тема 1. Риск как объект управления	2	2	-	14
Тема 2. Риск-менеджмент: понятие, стратегия и методы	2	2	-	14
Тема 3. Оценка риска	-	2	-	14
Тема 4. Банковские риски	-	2	-	14
Тема 5. Управление инфляционным риском	-	2	-	14
Тема 6. Управление валютным риском	-	2	-	14

Тема 7. Управление кредитным риском	-	-	-	12
Тема 8. Управление процентным риском	-	-	-	12
Тема 9. Хеджирование как способ управления рисками	-	-	-	11
Итого по 9 семестру	**4**	**12**	**-**	**119**

3.2. Краткое описание содержания тем (разделов) дисциплины

Краткое содержание курса (9 семестр)

Тема 1. Риск как объект управления

Риск как экономическая категория. Особенности риска. Три уровня субъектов, для которых возникает экономический риск.

Классификация рисков по различным признакам. Квалификационная система рисков. Категории, группы, виды, подвиды и разновидности рисков. Чистые и спекулятивные риски. Коммерческие и финансовые риски. Риски, связанные с покупательной способностью денег и инвестиционные риски. Систематические и несистематические риски.

Направления деятельности компании, при реализации которых возникают риски.

Тема 2. Риск-менеджмент: понятие, стратегия и методы.

Понятие риск-менеджмента и управления риском. Проблемы управления рисками. Конфликт интересов. Стратегия и тактика управления риском. Функции объекта и субъекта риск-менеджмента. Организация риск-менеджмента.

Роль интуиции и инсайта в управлении. Эвристические правила и приемы риск-менеджмента.

Основные этапы процесса управления рисками. Понятие управления риском. Главная цель управления риском. Задачи и принципы составления программы управления рисками. Убыток (ущерб) и его виды. Классы убытков. Максимально возможный и максимально вероятный риск.

Основные методы управления рисками: метод избежания рисков, метод принятия рисков на себя, метод предотвращения убытков, метод уменьшения размера убытков, страхование, самострахование, хеджирование, аренда, контракты типа hold-harmless. Правило выбора стратегических методов управления рисками.

Тема 3. Оценка риска

Финансовый риск как функция времени. «Дерево вероятностей» как метод количественной оценки риска. Метод построения «дерева вероятностей». Исходная вероятность. Условная вероятность. Совместная вероятность.

Критерии измерения величины риска: среднее ожидаемое значение, изменчивость (колеблемость) возможного результата. Математическое ожидание, среднее квадратическое отклонение, ковариация, вариация, коэффициент корреляции: определение значения и роль в определении величины риска. Пример расчета математического ожидания, стандартного отклонения и коэффициента вариации. Метод оценки рисков VaR. Метод оценки рисков Stress Testing. Аналитические методы.

Дискуссионные вопросы оценки величины риска в современных условиях. Процессо-ориентированные подходы. Стратегически ориентированные подходы.

Эвристические методы и модели. Экспертные методы и модели: коллективные и индивидуальные. Имитационные методы и модели. Последовательный анализ.

Тема 4. Банковские риски

Классификация рисков банковской деятельности. Внешние и внутренние риски. Риски пассивных и активных операций. Дискуссионные вопросы содержания рыночного риска банковской деятельности.

Особенности методов управления банковскими рисками. Требования и нормативы ЦБ РФ и их влияние на риски деятельности коммерческих банков.

Тема 5. Управление инфляционным риском

Явление инфляции и инфляционные процессы в экономике. Виды инфляции. Дефляция. Индекс инфляции. Темп инфляции. Понятие и сущность инфляционного риска.

Основные методы компенсации потерь от снижения покупательной способности денег. Защитные оговорки. Виды товарно-ценовых оговорок: оговорки о скользящей цене, индексные оговорки.

Индексация процентной ставки как способ управления инфляционным риском при выдаче кредитов. Величина наращенной суммы с учетом ее обесценения. Брутто-ставка и ее расчет.

Тема 6. Управление валютным риском

Понятие валютного риска и его виды. Операционный, трансляционный и экономический валютные риски.

Особенности управления трансляционным валютным риском.

Защитные оговорки как метод страхования валютных рисков. Виды защитных оговорок. Золотая (прямая и косвенная), валютная и многовалютная оговорки. Виды валютных корзин: симметричная, ассиметричная, стандартная, регулируемая. Элементы механизма действия валютной оговорки.

Компенсационные сделки. «Подушки». Компенсация и управление валютными операциями многонациональной компании.

Иные методы управления валютными рисками на производственных предприятиях. Структурная балансировка, изменение срока платежа, параллельные ссуды, форфейтирование, самострахование, страхование, хеджирование.

Тема 7. Управление кредитным риском

Понятие кредитного риска и его особенности. Дискуссионные вопросы о структуре кредитного риска. Оценка кредитного риска.

Тактические методы управления кредитным риском. Гарантии правительства или банка. Страхование международных кредитов.

Оценка кредитоспособности заемщика и эмитента как способ снижения кредитного риска. Система оценочных коэффициентов. Фундаментальный анализ эмитента и его бумаг. Формирование резерва на возможные потери по ссудам.

Кредитные деривативы как способ управления кредитным риском. Понятие и виды кредитных деривативов. Форварды, свопы, опционы, индексные инструменты как представители семейства кредитных деривативов.

Факторинговое обслуживание. Учет векселей.

Тема 8. Управление процентным риском

Понятие процентного риска и сфера его возникновения. Виды процентного риска: риск потерь от изменения потоков денежных средств, портфельный риск и экономический риск. Измерение процентного риска. Факторы, влияющие на процентный риск.

Основные методы управления процентным риском и приемы их реализации. Метод длительности, нейтрализация требований и обязательств, метод эффективной границы, пассивные стратегии управления портфелем ценных бумаг, хеджирование.

Тема 9. Хеджирование как способ управления рисками

Инструменты хеджирования − срочные контракты. Механизм функционирования срочного рынка. Товарные и финансовые деривативы. Особенности и виды форвардов, фьючерсов, опционов и свопов.

Понятие хеджирования. Возможности устранения систематического риска посредством операций с производными инструментами. Виды хеджирования. Техника и типы стратегий хеджирования форвардными и фьючерсными контрактами. Функция

дохода хеджера на форвардном и фьючерсном рынке. Перекрестное хеджирование. Коэффициенты хеджирования и необходимость их расчета. Эффективность операций хеджирования. Основной принцип хеджирования с помощью опционных контрактов. Функция дохода хеджера на опционном рынке. Своп в качестве инструмента хеджирования.

4. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

Общий объем самостоятельной работы студентов по дисциплине включает аудиторную и внеаудиторную самостоятельную работу студентов в течение семестра.

Аудиторная самостоятельная работа осуществляется в форме выполнения индивидуальных заданий по дисциплине.

Внеаудиторная самостоятельная работа осуществляется в формах:

- подготовка к практическим занятиям;
- подготовка реферата.

ОС-1 Защита реферата

Примерная тематика рефератов

1. Понятие и виды рисков.
2. Особенности банковских рисков.
3. Предпринимательские риски.
4. Методы количественной оценки риска.
5. Риск-менеджмент. Стратегии риск-менеджмента.
6. Риски, возникающие при осуществлении экспортно-импортных операций. Их специфика.
7. Методы управления валютными рисками на предприятии.
8. Управление процентными рисками на предприятии.
9. Управление кредитными рисками на предприятии.
10. Персонализация риска. Управление рисками, связанными с воздействием эмоций.
11. Риски, связанные с конфликтогенностью в организации.
12. Транспортные риски: понятие, международная классификация, управление.
13. Риски логистики и транспортировки.
14. Риски, возникающие при проведении биржевых операций на товарном и фондовом рынках.
15. Управление рисками инновационной деятельности.
16. Политические риски и их влияние на деятельность коммерческой организации.
17. Специфика управления рисками в страховых компаниях.
18. Информационные риски и уклонение организаций от них.
19. Хеджирование как метод управления рисками. Инструменты хеджирования.
20. Особенности использования соглашений о процентной ставке (FRA) в управлении процентным риском.
21. Форвардные, фьючерсные и опционные контракты как инструменты управления финансовыми рисками.
22. Личностные факторы, влияющие на степень риска при принятии управленческих решений.
23. Диверсификация как метод управления финансовыми рисками.
24. Риски, связанные с организацией туризма. Риск менеджмент туризма.
25. Управление рисками предприятий сферы сервиса.
26. Управление рисками инвестиционного проекта.
27. Управление рисками гостиничного и ресторанного бизнеса.
28. Оценка эффективности методов управления рисками и выбор управленческого решения.
29. Особенности управления рисками предприятий оптовой и розничной торговли.
30. Специфика методов управления банковскими рисками.

ОС-2 ***Индивидуальные задания***
Примеры индивидуальных заданий

Задание 1. Подготовить презентацию «Особенности риск-менеджмента на предприятиях сервиса».

Задание 2. Подготовить презентацию «Методы оценки рисков на предприятиях сервиса».

Задание 3. Подготовить презентацию «Методы управления рисками на предприятиях сервиса».

Задание 4. Подготовить презентацию «Методы минимизации последствий наступления рисковых событий на предприятиях сервиса».

Задание 5. Подготовить презентацию «Направления совершенствования риск-менеджмента в сервисе».

Для самостоятельной подготовки к занятиям по дисциплине рекомендуется использовать учебно-методические материалы:

1.Риск-менеджмент: учебно-методические рекомендации / составители: М. А. Суркова, А. Е. Щеглова, М. А. Рябова, А. С. Мокроусов ; Министерство просвещения РФ ; Ульяновский государственный педагогический университет им. И. Н. Ульянова. — Ульяновск : ФГБОУ ВО «УлГПУ им. И. Н. Ульянова», 2021. — 16 с. — http://els.ulspu.ru/?song_lyric=%d1%80%d0%b8%d1%81%d0%ba-%d0%bc%d0%b5%d0%bd%d0%b5%d0%b4%d0%b6%d0%bc%d0%b5%d0%bd%d1%82-2

5. Примерные оценочные материалы для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

Организация и проведение аттестации студента

ФГОС ВО в соответствии с принципами Болонского процесса ориентированы преимущественно не на сообщение обучающемуся комплекса теоретических знаний, но на выработку у бакалавра компетенций – динамического набора знаний, умений, навыков и личностных качеств, которые позволят выпускнику стать конкурентоспособным на рынке труда и успешно профессионально реализовываться.

В процессе оценки бакалавров необходимо используются как традиционные, так и инновационные типы, виды и формы контроля. При этом постепенно традиционные средства совершенствуются в русле компетентностного подхода, а инновационные средства адаптированы для повсеместного применения в российской вузовской практике.

Цель проведения аттестации – проверка освоения образовательной программы дисциплины-практикума через сформированность образовательных результатов.

Промежуточная аттестация осуществляется в конце семестра и завершает изучение дисциплины; помогает оценить крупные совокупности знаний и умений, формирование определенных компетенций.

Оценочными средствами текущего оценивания являются: доклад, тесты по теоретическим вопросам дисциплины, защита индивидуальных работ и т.п. Контроль усвоения материала ведется регулярно в течение всего семестра на практических (семинарских, лабораторных) занятиях.

№ п/п	**СРЕДСТВА ОЦЕНИВАНИЯ,** используемые для текущего оценивания показателя формирования компетенции	Образовательные результаты дисциплины
1	**Оценочные средства для текущей аттестации**	ОР-1 знает основы

	ОС-1 Защита реферата ОС-2 Выполнение индивидуального задания	взаимодействия с персоналом, управления персоналом ОР-2 умеет проводить анализ и оценку организации труда персонала ОР-3 владеет навыками разработки мероприятий, направленных на повышение эффективности организации труда ОР-4 знает основы функционирования предприятия сервиса, организации деятельности предприятия сервиса ОР-5 умеет планировать, анализировать деятельность предприятия сервиса, сравнивать полученный результат с планируемым, выявлять причины расхождения панируемого и реального результатов ОР-6 владеет навыками применения методов организации деятельности предприятия сервиса с учетом изменения конъюнктуры рынка и спроса потребителей, а также социальной политики государства ОР-7 знает основы ведения деловых переговоров, осуществления коммуникаций с контактными аудиториями ОР-8 умеет вести переговоры, осуществлять коммуникации с контактными аудиториями ОР-9 владеет навыками ведения деловых переговоров
2	**Оценочные средства для промежуточной аттестации** **экзамен** ОС-3 Экзамен в форме устного собеседования по вопросам	

Описание оценочных средств и необходимого оборудования (демонстрационного материала), а также процедуры и критерии оценивания индикаторов достижения компетенций на различных этапах их формирования в процессе освоения образовательной программы представлены в Фонде оценочных средств «Риск-менеджмент».

Материалы, используемые для текущего контроля успеваемости обучающихся по дисциплине

Материалы для организации текущей аттестации представлены в п.5 программы.

Материалы, используемые для промежуточного контроля успеваемости обучающихся по дисциплине

ОС-3 Экзамен в форме устного собеседования по вопросам
Перечень вопросов к экзамену

1. Понятие риска и его особенности как экономической категории
2. Уровни субъектов, для которых возникает экономический риск
3. Взаимосвязь категорий риск и доходность
4. Взаимосвязь понятий «риск» и «убытки»
5. Классификация рисков в зависимости от возможного результата, от основной причины возникновения
6. Квалификационная система рисков
7. Краткая характеристика финансовых рисков
8. Риски, возникающие при осуществлении таможенной деятельности
9. Риски, возникающие при проведении экспортно-импортных операций
10. Краткая характеристика коммерческих рисков
11. Сущность процесса управления рисками
12. Этапы управления рисками. Функции риск-менеджера на каждом этапе
13. Направления деятельности компании, при осуществлении которых возникают риски
14. Понятие и виды убытков
15. Классы убытков
16. Максимально возможный и максимально вероятный риск. Значение их оценки
17. Суть метода избежания убытков
18. Суть метода принятия рисков на себя
19. Суть метода предотвращения убытков
20. Суть метода уменьшения размера убытков
21. Суть метода страхования
22. Суть метода самострахования
23. Суть метода хеджирования
24. Методы передачи риска и их содержание
25. Пересмотр программ управления рисками
26. Основные подходы к оценке риска
27. Метод построения дерева вероятностей
28. Исходная, условная и совместная вероятности. Методы их подсчета
29. Критерии измерения величины (степени) риска
30. Недостатки показателя ковариации, влияющие на точность оценки величины риска
31. Характеристика коэффициента вариации и качественная оценка его значений
32. Характеристика процесса инфляции и оценка уровня цен. Понятие инфляционного риска
33. Методы управления инфляционным риском
34. Понятие и виды валютного риска
35. Управление трансляционным валютным риском
36. Защитные оговорки как метод управления валютным риском. Виды валютных оговорок
37. Преимущества многовалютной оговорки по сравнению с одновалютной оговоркой
38. Виды валютных корзин (валютных «коктейлей»)
39. Суть методики «компенсация»
40. «Подушки» способ устранения валютного риска. Риски, возникающие при использовании «подушки»
41. Понятие кредитного риска и сфера его возникновения

42. Основные способы защиты от кредитных рисков
43. Порядок формирования и использования резерва на возможные потери по ссудам в коммерческом банке
44. Принципы ликвидности и рычаги воздействия со стороны государственных органов по их обязательному соблюдению
45. Кредитные диревативы: понятие, виды и их использование для управления кредитным риском
46. Понятие и виды процентного риска. Сферы его возникновения
47. Особенности управления процентным риском в коммерческом банке
48. Понятие хеджирования
49. Сущность и виды форвардных контрактов
50. Понятие и виды фьючерсных контрактов
51. Особенности опционных контрактов и их классификация
52. Виды хеджирования и техника проведения операций с различными инструментами
53. Особенности хеджирования валютного риска. Используемые инструменты
54. Особенности хеджирования процентного риска. Используемые инструменты
55. Свопы как инструменты передачи риска

В конце изучения дисциплины подводятся итоги работы студентов на лекционных и практических занятиях путем суммирования заработанных баллов в течение семестра.

Критерии оценивания знаний обучающихся по дисциплине

Формирование балльно-рейтинговой оценки работы обучающихся

		Посещение лекций	Посещение практических занятий	Работа на практических занятиях	Экзамен
9 семестр	Разбалловка по видам работ	2 х 1=2 балла	6 х 1=6 баллов	296 баллов	96 баллов
	Суммарный макс. балл	2 балла max	8 баллов max	304 баллов max	400 баллов max

Критерии оценивания работы обучающегося по итогам 9 семестра

Оценка	**Баллы (4 ЗЕ)**
«отлично»	361-400
«хорошо»	281-360
«удовлетворительно»	201-280
«неудовлетворительно»	200 и менее

6. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Успешное изучение курса требует от обучающихся посещения лекций, активной работы на практических занятиях, выполнения всех учебных заданий преподавателя, ознакомления с основной и дополнительной литературой.

Запись **лекции** – одна из форм активной самостоятельной работы обучающихся, требующая навыков и умения кратко, схематично, последовательно и логично фиксировать основные положения, выводы, обобщения, формулировки. В конце лекции преподаватель оставляет время (5 минут) для того, чтобы обучающиеся имели возможность задать уточняющие вопросы по изучаемому материалу. Из-за недостаточного количества аудиторных часов некоторые темы не удается осветить в полном объеме, поэтому преподаватель, по своему усмотрению, некоторые вопросы выносит на

самостоятельную работу студентов, рекомендуя ту или иную литературу. Кроме этого, для лучшего освоения материала и систематизации знаний по дисциплине, необходимо постоянно разбирать материалы лекций по конспектам и учебным пособиям. В случае необходимости обращаться к преподавателю за консультацией.

Подготовка к практическим занятиям.

При подготовке к практическим занятиям студент должен изучить теоретический материал по теме занятия (использовать конспект лекций, изучить основную литературу, ознакомиться с дополнительной литературой, при необходимости дополнить конспект, делая в нем соответствующие записи из литературных источников). В случае затруднений, возникающих при освоении теоретического материала, студенту следует обращаться за консультацией к преподавателю. Идя на консультацию, необходимо хорошо продумать вопросы, которые требуют разъяснения.

В начале практического занятия преподаватель знакомит студентов с темой, оглашает план проведения занятия, выдает задания. В течение отведенного времени на выполнение работы студент может обратиться к преподавателю за консультацией или разъяснениями. В конце занятия проводится прием выполненных заданий, собеседование со студентом.

Результаты выполнения практических зданий оцениваются в баллах, в соответствии с балльно-рейтинговой системой университета.

Планы практических занятий
9 семестр

Практическое занятие по теме № 1. Риск как объект управления

Рекомендации к самостоятельной работе:

1. Повторить лекционный материал по теме «Риск как объект управления».
2. Ознакомиться с материалом для самостоятельного изучения, используя источники из перечня основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины и рекомендованные интернет-источники.
3. Ответить на контрольные вопросы.

Контрольные вопросы:

1. Понятие риска и признаки экономического риска
2. Квалификационная система рисков
3. Систематические и несистематические риски.
4. Субъекты, подвергающиеся экономическим рискам
5. Рефераты выявления рисков

Практическое занятие по теме № 2. Риск-менеджмент: понятие, стратегия и методы.

Рекомендации к самостоятельной работе:

1. Повторить лекционный материал по теме «Риск-менеджмент: понятие, стратегия и методы».
2. Ознакомиться с материалом для самостоятельного изучения, используя источники из перечня основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины и рекомендованные интернет-источники.
3. Ответить на контрольные вопросы.

Контрольные вопросы:

1. Риск-менеджмент и программы управления риском
2. Эвристические правила и приемы риск-менеджмента.
3. Стратегические методы управления рисками
4. Рефераты по составлению первоначальных программ управления рисками

Практическое занятие по теме № 3. Оценка риска

Рекомендации к самостоятельной работе:

1. Повторить лекционный материал по теме «Оценка риска».

2. Ознакомиться с материалом для самостоятельного изучения, используя источники из перечня основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины и рекомендованные интернет-источники.

3. Ответить на контрольные вопросы.

Контрольные вопросы:

1. Дискуссионные вопросы оценки величины риска в современных условиях.
2. Статистические методы оценки рисков
3. Экспертные методы оценки рисков: индивидуальные и коллективные
4. Рефераты оценки рисков

Практическое занятие по теме № 4. Банковские риски

Рекомендации к самостоятельной работе:

1. Повторить лекционный материал по теме «Банковские риски».

2. Ознакомиться с материалом для самостоятельного изучения, используя источники из перечня основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины и рекомендованные интернет-источники.

3. Ответить на контрольные вопросы.

Контрольные вопросы:

1. Виды рисков банковской деятельности
2. Дискуссионные вопросы содержания рыночного риска банковской деятельности.
3. Деятельность ЦБР по управлению рисками банковской деятельности
4. Методы управления банковскими рисками
5. Рефераты по теме

Практическое занятие по теме № 5. Управление инфляционным риском

Рекомендации к самостоятельной работе:

1. Повторить лекционный материал по теме «Управление инфляционным риском».

2. Ознакомиться с материалом для самостоятельного изучения, используя источники из перечня основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины и рекомендованные интернет-источники.

3. Ответить на контрольные вопросы.

Контрольные вопросы:

1. Инфляционные процессы в экономике. Виды инфляции.
2. Основные стратегические и тактические методы управления инфляционным риском
3. Рефераты по теме

Практическое занятие по теме № 6. Управление валютным риском

Рекомендации к самостоятельной работе:

1. Повторить лекционный материал по теме «Управление валютным риском».

2. Ознакомиться с материалом для самостоятельного изучения, используя источники из перечня основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины и рекомендованные интернет-источники.

3. Ответить на контрольные вопросы.

Контрольные вопросы:

1. Понятие валютного риска и его виды.
2. Методы управления трансляционным валютным риском
3. Стратегические и тактические методы управления операционным и экономическим валютными рисками
4. Рефераты по теме

7. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, Интернет-ресурсов, необходимых для освоения дисциплины

Основная литература

1. Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент : учебник / А. Н. Фомичев. – 7-е изд. – Москва : Дашков и К°, 2020. – 372 с. : ил. – (Учебные издания для бакалавров). – Режим доступа: по подписке. – URL: https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=573397
2. Суворова, А. П. Риск-менеджмент : учебное пособие / А. П. Суворова, О. М. Репина ; Поволжский государственный технологический университет. – Йошкар-Ола : Поволжский государственный технологический университет, 2018. – 176 с. : ил. – Режим доступа: по подписке. – URL: https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=560489 (дата обращения: 12.07.2021). – Библиогр. в кн. – ISBN 978-5-8158-2036-4. – Текст : электронный.

Дополнительная литература

3. Семенов, А. К. Менеджмент : практикум для бакалавров / А. К. Семенов, В. И. Набоков. - 6-е изд., перераб. - Москва : Дашков и К, 2020. - 202 с. - ISBN 978-5-394-03883-9.
URL: https://znanium.com/catalog/product/1232141
4. Окулов, В. Л. Риск-менеджмент : основы теории и практика применения : учебное пособие / В. Л. Окулов. - СПб : Изд-во С.-Петерб. ун-та, 2019. - 280 с. - ISBN 978-5-288-05936-0. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1080924 (дата обращения: 12.07.2021). – Режим доступа: по подписке.

Интернет-ресурсы

1. https://www.minfin.ru/ru/- Министерство финансов РФ
2. https://www.cbr.ru – Центральный Банк РФ
3. http://www.consultant.ru - Справочно-правовая система «Консультант Плюс»
4. https://www.garant.ru – Справочно-правовая система «Гарант»
5. https://rusnap.ru/about/ - Национальная ассоциация предпринимателей