

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования
«Тихоокеанский государственный университет»
Кафедра финансов, кредита и бухгалтерского учета

КОРПОРАТИВНЫЙ РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ

Методические указания к выполнению контрольной работы
для магистров заочной формы обучения.

Направление подготовки 38.04.08 Финансы и кредит
Магистерская программа – Корпоративные финансы

Составитель, доцент Леонова Н.Г. _____
Зав.кафедрой ФК и БУ Федоров В.А. _____

Хабаровск
ТОГУ
2016

Общие положения

Целью освоения дисциплины является получение профессиональных навыков и умений идентификации, оценки и управления рисками фирмы, что включает применение современного инструментария. Для достижения цели ставятся следующие задачи:

1. Сформировать представления о способах идентификации рисков хозяйствующего субъекта или фирмы;
2. Изучить этапы оценки и управления рисками;
3. Выявить проблемы применения математического аппарата в оценке различных форм риска фирмы;
4. Овладеть базовыми приемами идентификации риска фирмы.

В результате освоения дисциплины обучающийся должен:

1. Знать: основные виды финансового риска, встречающихся в деятельности корпорации; методы качественного и количественного анализа финансовых рисков; виды показателей идентификации финансовых рисков; методы проведения анализа и оценки финансово-экономических рисков; типовые методики оценки рисков корпорации, а также способен построить прогноз финансово-экономических показателей и дать его обоснование; основные способы прогнозирования финансово-экономических показателей; способы измерения рисков реализации проектов, обоснования их влияние на финансовые показатели; какие риски могут сопровождать реализацию тех или иных проектов, а также может на основе типовых методик рассчитать показатели оценки рисков.

2. Уметь: выявлять риски в деятельности корпорации; давать количественную и качественную оценку рисков деятельности корпорации; рассчитывать показатели количественного анализа финансовых рисков; обосновывать стратегию поведения и развития различных корпораций; прогнозировать динамику основных финансово-экономических показателей; условия применения прогнозирования; рассчитывать показатели оценки рисков на основе приведенных данных.

3. Владеть: инструментарием управления финансовыми рисками корпорации; современными информационными технологиями управления корпоративными рисками; может использовать методики оценки рисков корпорации, а также способен построить прогноз финансово-экономических показателей и дать его обоснование; представлением о способах анализа и оценки финансово-экономических рисков; способен на основе приведенных данных дать количественную оценку рискам реализации проектов

1. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Преподавание дисциплины предусматривает следующие формы организации учебного процесса: практические занятия, семинары, самостоятельная работа, тестирование, консультации, решение кейсовых заданий. При изложении тем курса используется действующее законодательство.

№	Этапы формирования компетенции (темы, разделы, модули дисциплины)	Индекс компетенции	Наименование оценочного средства контроля (с указанием формы контроля)
1	Комплексный подход к постановке и развитию системы риск-менеджмента. Системные риски холдинговых	ПК-4 ПК-23	Презентация. Кейс-задания. Письменная работа
2	Система риск-менеджмента	ПК-4 ПК-23	Подготовка к практическим занятиям
3	Разработка матрицы задач управления рисками. Оценка рискового спектра организации. Качественная и	ПК-4 ПК-23	Презентация. Кейс-задания. Тест
4	Стратегии управления рисками	ПК-4 ПК-23	Подготовка к практическим занятиям
5	Линейные карты распределения ответственности	ПК-23	Презентация. Кейс-задания
6	Риск-ориентированный подход	ПК-4 ПК-23	Подготовка к практическим занятиям
7	Оценка эффективности системы риск-менеджмента	ПК-4 ПК-23	Презентация. Кейс-задания. Тест.
8	Организацию управления рисками для противодействия внутрикорпоративному контролю	ПК-23	Презентация. Кейс-задания. Письменная работа
9	Оценка эффективности системы риск-менеджмента	ПК-4 ПК-23	Подготовка к практическим занятиям

2. ВЫПОЛНЕНИЕ КОНТРОЛЬНОЙ РАБОТЫ

В соответствии с учебным планом магистранты выполняют контрольную работу по дисциплине "Корпоративный риск-менеджмент", которая позволяет оценить знания и усвоение учебного материала. Выполнение контрольной работы, является важным этапом изучения курса, формой самостоятельного изучения. Целью выполнения контрольной работы является закрепление теоретических знаний курса, более глубокое их изучение, освоение практических аспектов рассматриваемых в работе вопросов.

Выполнение контрольной работы – одна из форм самостоятельной работы магистрантов. Приступая к выполнению работы студент должен ознакомиться с программой курса, освоить основные понятия изучаемого курса. Выполнение работы предусматривает изучение теоретических вопросов и обязательный анализ отчетности предприятий путем решения практических задач.

Контрольная работа выполняется самостоятельно. Не допускается механическое копирование текста учебников и других источников. В случае использования цитат, на них необходимо делать ссылки с указанием автора, названия и страницы источника. Нарушение этих требований влечет за собой неудовлетворительную оценку.

Выполнение контрольной работы проходит следующие этапы:

1. Выбор варианта.
2. Ознакомление с требованиями к выполнению контрольной работы.
3. Подбор литературных источников.
4. Составления плана контрольной работы.
5. Написание и оформление контрольной работы.
6. Защита контрольной работы.

3. ОСНОВНЫЕ ТРЕБОВАНИЯ К НАПИСАНИЮ КОНТРОЛЬНОЙ РАБОТЫ

Работа должна быть выполнена в редакторе Word в печатном варианте. При выполнении работы необходимо придерживаться следующих общих требований: текст располагается на листе формата А4 без рамок с соблюдением размеров полей: левое – 30 мм, правое – 10 мм, верхнее – 15 мм, нижнее – 20 мм. Нумерация страницы указывается в правом верхнем углу. Шрифт – Times New Roman, размер – 14, интервал - полуторный.

Контрольная работа должна включать: содержание, введение, основную

часть, заключение, список использованных источников. Документ должен быть выполнен в соответствии с СТО 02067971.106–2015 Стандарт организации.

Образец титульного листа контрольной работы приведен в приложении А. В содержании перечисляют введение, заголовки разделов и подразделов, заключение, список использованных источников. Содержание начинают с нового листа.

Введение является обязательным разделом текстового документа. Введение должно содержать актуальность темы. Во введении формируется цель и задачи контрольной работы. Рекомендуемый объем работы – 1 страница. Введение начинают с нового листа.

Основная часть отражает процесс решения поставленных в контрольной работы задач. Наименование разделов основной части должны отражать выполнение задания.

Заключение является обязательным разделом текстового документа контрольной работы и должно содержать краткие выводы по результатам выполненной работы. Заключение начинают с нового листа, рекомендуемый объем – 1 страница.

Список использованных источников является обязательным разделом и включается в содержание текстового документа. Список должен содержать не менее 10 литературных источников.

Контрольная работа должна состоять из следующих частей:

- ✓ введение;
- ✓ теоретическая часть, состоящая из ответа на поставленный вопрос;
- ✓ заключение;
- ✓ список использованных источников.

Полностью готовая и оформленная работа должна быть представлена преподавателю кафедры для проверки. Срок проверки работы – 10 дней. После проверки преподаватель дает заключение о допуске к защите или необходимости доработки.

Изменение варианта работы не допускается без письменного разрешения преподавателя.

После выполнения работы магистр сдает её на кафедру в установленные программой и деканатом сроки. Срок проверки работы составляет 10 дней. После проверки преподаватель дает заключение о качестве выполнения контрольной работы.

Основные критерии оценки контрольной работы - обоснованность и точность проведенного решения. При этом учитывается качество оформления и логичность изложения.

Получение положительной оценки по контрольной работе предусматривает выполнение всех представленных требований. К собеседованию магистр обязан учесть все замечания отмеченные в работе. Неудовлетворительную оценку магистр получает в случае не выполнения предъявленных требований.

4. ЗАДАНИЕ НА ВЫПОЛНЕНИЕ КОНТРОЛЬНОЙ РАБОТЫ

1. Классификация рисков
2. Виды проектных стратегий для минимизации партнерских рисков
3. Методы прогнозирования в риск-менеджменте
4. Методы качественной оценки рисков
5. Методы количественной оценки рисков
6. Способы минимизации рисков
7. Оценочные резервы как способ минимизации рисков
8. Стратегические риски и методы их снижения
9. Проблемы управления рисками на российских предприятиях
10. Системные риски холдинговых структур
11. Роль риск-менеджера в общей структуре управления рисками
12. Технология организации процесса риск-менеджмента на нефинансовых предприятиях
13. Сценарии как один из методов минимизации рисков
14. Методика построения сценариев. Основные этапы разработки сценариев
15. Применение метода анализа иерархий для принятия управленческих решений
16. Ранжирование сценариев по их влиянию на финансовые результаты деятельности предприятия
17. Способы минимизации контрактных рисков
18. Тенденции в управлении стратегическими рисками нефинансовых предприятий
19. Комплексный подход к управлению рисками нефинансовых предприятий: разработка алгоритма управления рисками
20. Динамика профиля рисков для российских предприятий
21. Особенности выбора метода минимизации рисков. Подбор методов анализа рисков
22. Линейные карты распределения ответственности
23. Организация управления рисками для противодействия внутрикорпоративному мошенничеству.

ПРИЛОЖЕНИЕ А
Пример оформления титульного листа работы

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования
«Тихоокеанский государственный университет»
Кафедра финансов, кредита и бухгалтерского учета

КОНТРОЛЬНАЯ РАБОТА
по дисциплине: «Финансовый менеджмент»

Тема "...."

Выполнил:
магистрант гр. КФз – 21
Иванов Иван Иванович
номер зачетной книжки
Проверил: