

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ**  
**«ДОНСКОЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ»**

**(ДГТУ)**

**Отдел магистратуры**

Кафедра **«Эксплуатация транспортных систем и логистика»**

**Методические указания для выполнения контрольных работ**

По дисциплине «Риск- менеджмент»

ОПОП Эксплуатация транспортно- технологических машин и комплексов

Направление 23.04.03 03 Эксплуатация и ремонт автотранспортных средствФорма освоения ООП: заочная

Ростов-на-Дону

2017

Контрольная работа №1

***1. Составить глоссарий***

Термины: риск, опасность, случайность, ничтожный риск, приемлемый риск, чрезмерный риск.

***2. Письменно ответить на 5 вопросов:***

1. Сущность и содержание понятия «риск».
2. Общие подходы к классификации рисков
3. Каким образом можно классифицировать риски? Назовите основные классы рисков
4. Дайте определение и назовите основные характеристики промышленных рисков.
5. Какие основные виды инвестиционных рисков вы знаете?
6. Дайте краткую характеристику финансовых и коммерческих рисков.
7. Какие методы прогнозирования Вы знаете?
8. Как соотносятся риск и неопределенность?
9. Чем объясняется многообрази характеристик риска?
10. Как обычно решают многокритериальные задачи управления риском?

***3. Выполнить задания.***

**Задание 1.** На основе изучения литературных источников и Интернет-источников подобрать список используемых источников и литературы, необходимый для изучения методов и программ управления рисками. Результаты оформить в письменном виде.

**Ситуация 2.** Вы располагаете следующими видами активов: ГКО, муниципальная облигация, привилегированная акция «Промстройбанка», обыкновенная акция «Томсктелеком», простой вексель «Томскэнерго». Расположите вышеперечисленные виды активов по мере убывания степени риска.

**Ситуация 3.** Оценить риск потери платѐжеспособности предприятия по данным бухгалтерской отчѐтности, наметить приемлемую (с точки зрения уменьшения риска потери платѐжеспособности) структуру баланса на перспективу. Составить целевую программу снижения риска платѐжеспособности предприятия на ближайшие годы.

***4. Написать реферат по одной из предложенных тем.***

1. Причины и факторы усиления техногенной опасности.
2. Концепция обеспечения пригодности грузоподъемного технического объекта к использованию по требованиям безопасности.
3. Количественная оценка риска подъемных сооружений.
4. Распознавание опасности подъемных сооружений.
5. Факторы опасности, опасные ситуации и опасные события на подъемных сооружениях.
6. Опасности, связанные с нарушением организационных требований и ошибочными действиями персонала, обслуживающего подъемные сооружения.
7. Опасность повреждения нарушения технического состояния металлоконструкций кранов.
8. Сочетание элементов риска подъемных сооружений.

Контрольная работа №2

***1. Составить глоссарий***

Термины: риск, опасность, случайность, ничтожный риск, приемлемый риск, чрезмерный риск.

***2. Письменно ответить на 3 вопроса:***

1. Основные черты и функции риска.
2. Общие подходы к классификации рисков
3. Объясните актуальность рискологических теорий в современной науке
4. Дайте определение понятия «риск». Разъясните понятия «опасность», «случайность» и «ущерб» применительно к риску.
5. Дайте краткую характеристику предпринимательских рисков.
6. Назовите основные особенности страновых рисков и охарактеризуйте их.
7. Какие методы прогнозирования Вы знаете?
8. Как соотносятся риск и неопределенность?
9. Рассмотрите различные виды рисков, которые следует учитывать при работе предприятия.
10. Чем объясняется многообразие характеристик риска?

***3. Выполнить задания.***

**Задание 1.** Осуществить построение системы управления рисками в медицинской организации. При этом основными шагами построения такой системы являются:

1.Классификация рисков организации.

2.Организационная структура управления рисками и распределение рисков по уровням управления.

3.Функционирование системы управления рисками: выявление, оценка, управление, мониторинг.

4.Стратегии и тактики управления рисками в организации.

5.Оценка эффективности системы управления рисками.

**Ситуация 2.** Имеются два инвестиционных проекта с одинаковой прогнозной суммой требуемых капитальных вложений. Величина планируемого дохода (тыс. руб.) неопределенна и приведена в виде распределения вероятностей (табл.). Оценить рискованность каждого проекта, используя критерий отбора – «максимизация математического ожидания дохода». Характеристика проектов по доходам и вероятностям его получения:

*Инвестиционный проект 1 Доход, тыс. руб. Вероятность (В) 2500 0,15 3000 0,20 3500 0,35 5000 0,20 6000 0,10*

*Инвестиционный проект 2*

*Доход, тыс. руб. Вероятность (В) 1500 0,10 2500 0,15 4000 0,30 5000 0,30 7000 0,15*

**Ситуация 3.** Рассматривается 2-летний проект финансовых вложений. Прогнозируемые значения чистого денежного потока по годам составляют 7 тыс. руб. Бета-коэффициент проекта оценивается на уровне 1,4. При безрисковой процентной ставке 12 % и доходности рыночного портфеля 20 % определите требуемую доходность.

***4. Написать реферат по одной из предложенных тем.***

1. Причины и факторы усиления техногенной опасности.
2. Концепция обеспечения пригодности грузоподъемного технического объекта к использованию по требованиям безопасности.
3. Количественная оценка риска подъемных сооружений.
4. Распознавание опасности подъемных сооружений.
5. Факторы опасности, опасные ситуации и опасные события на подъемных сооружениях.
6. Опасности, связанные с нарушением организационных требований и ошибочными действиями персонала, обслуживающего подъемные сооружения.
7. Опасность повреждения нарушения технического состояния металлоконструкций кранов.
8. Сочетание элементов риска подъемных сооружений.

Контрольная работа №3

***1. Составить глоссарий***

Термины: риск, опасность, случайность, ничтожный риск, приемлемый риск, чрезмерный риск.

***2. Письменно ответить на 3 вопроса:***

1. Основные черты и функции риска.
2. Факторы риска и их классификация.
3. Объясните актуальность рискологических теорий в современной науке
4. Дайте определение понятия «риск». Разъясните понятия «опасность», «случайность» и «ущерб» применительно к риску.
5. Дайте определение и назовите основные характеристики промышленных рисков.
6. Дайте определение и назовите основные характеристики экологических рисков.
7. Какие основные виды инвестиционных рисков вы знаете?
8. Какие методы прогнозирования Вы знаете?
9. Как обычно решают многокритериальные задачи управления риском?

***3. Выполнить задания.***

**Задание 1.** На основе изучения литературных источников и Интернет-источников подобрать список используемых источников и литературы, необходимый для изучения методов и программ управления рисками. Результаты оформить в письменном виде.

**Ситуация 2.** Имеются два инвестиционных проекта с одинаковой прогнозной суммой требуемых капитальных вложений. Величина планируемого дохода (тыс. руб.) неопределенна и приведена в виде распределения вероятностей (табл.). Оценить рискованность каждого проекта, используя критерий отбора – «максимизация математического ожидания дохода». Характеристика проектов по доходам и вероятностям его получения:

*Инвестиционный проект 1 Доход, тыс. руб. Вероятность (В) 2500 0,15 3000 0,20 3500 0,35 5000 0,20 6000 0,10*

*Инвестиционный проект 2*

*Доход, тыс. руб. Вероятность (В) 1500 0,10 2500 0,15 4000 0,30 5000 0,30 7000 0,15*

**Ситуация 3.** Рассматривается 2-летний проект финансовых вложений. Прогнозируемые значения чистого денежного потока по годам составляют 7 тыс. руб. Бета-коэффициент проекта оценивается на уровне 1,4. При безрисковой процентной ставке 12 % и доходности рыночного портфеля 20 % определите требуемую доходность.

***4. Написать реферат по одной из предложенных тем.***

1. Причины и факторы усиления техногенной опасности.
2. Концепция обеспечения пригодности грузоподъемного технического объекта к использованию по требованиям безопасности.
3. Количественная оценка риска подъемных сооружений.
4. Распознавание опасности подъемных сооружений.
5. Факторы опасности, опасные ситуации и опасные события на подъемных сооружениях.
6. Опасности, связанные с нарушением организационных требований и ошибочными действиями персонала, обслуживающего подъемные сооружения.
7. Опасность повреждения нарушения технического состояния металлоконструкций кранов.
8. Сочетание элементов риска подъемных сооружений.