Частное образовательное учреждение

высшего образования

«Брянский институт управления и бизнеса»

**\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_**

УТВЕРЖДАЮ:

Заведующий кафедрой

«Экономика и управление»

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_Е.А. Мукайдех

«\_\_29\_» \_августа\_ 2019 г.

МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ПО ВЫПОЛНЕНИЮ

КОНТРОЛЬНОЙ РАБОТЫ

ПО ДИСЦИПЛИНЕ РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ

направление подготовки: 38.03.02 Менеджмент

(уровень высшего образования бакалавриат)

профиль подготовки: Управление проектом

Брянск 2019

1. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ПО ВЫПОЛНЕНИЮ КОНТРОЛЬНОЙ РАБОТЫ

Контрольная работа по дисциплине служит для закрепления студентом полученных теоретических знаний и приобретения им навыков в антикризисном управлении предприятиями.

Методические указания предназначены для студентов заочной формы обучения направления подготовки 38.03.01 Менеджмент и состоят из 3 частей: пояснения по оформлению, варианты контрольных работ и методические указания по выполнению практической части контрольной работы.

Номер варианта контрольной работы определяется по порядковому номеру студента в списке группы.

Контрольную работу следует представить на проверку преподавателю:

- в электронном виде (адрес электронной почты секции «Менеджмент» biub.sek.mn@mail.ru),

- в бумажном виде (секция «Менеджмент»).

Контрольная работа считается выполненной, если содержание раскрыто полностью

и соблюдены требования к оформлению.

Все замечания по контрольной работе преподаватель указывает на полях по тексту работы. Студент должен сделать соответствующую доработку и поместить ее в конец работы с пометкой «Доработка по замечаниям преподавателя».

Окончательная оценка по контрольной работе («зачет» или «незачет») выставляется после собеседования. Студенты, успешно прошедшие собеседование, допускаются к сдаче экзамена или зачета по дисциплине.

Контрольная работа должна быть выполнена на 12-15 листах компьютерного набора.

При написании теоретической части работы студенты пользуются рекомендованной и самостоятельно подобранной литературой (год издания не более 5 лет), делая ссылки

например, [1, c.29].

Необходимо использовать иллюстрационный материал – таблицы, диаграммы, схемы и т.п. Работа оформляется с использованием компьютера на одной стороне листа белой бумаги формата А4 через полтора интервала. Цвет шрифта– черный, тип – Times New Roman, размер – 14. Выравнивание текста – по ширине страницы. Каждый абзац текста начинается с красной строки, при этом отступ составляет 1,25.

В тексте могут быть приведены перечисления, перед каждым из них следует ставить маркер (тире). Текст после маркера начинается со строчной буквы и заканчивается точкой с запятой.

Работу следует печатать, соблюдая следующие размеры полей: правое – 10 мм, верхнее и нижнее – 15 мм, левое– 20 мм.

Графики, схемы, диаграммы располагаются непосредственно после текста, имеющего на них ссылку (выравнивание по центру страницы). Название графиков, схем, диаграмм помещается под ними, например,



Рисунок 1 – Типы антикризисных проектов риск-менедюмента

Нумерация рисунков сквозная в пределах всей работы.

Таблицы располагаются непосредственно после текста, имеющего на них ссылку. Таблицы нумеруются арабскими цифрами сквозной нумерацией в пределах всей работы. Название таблицы следует помещать над таблицей слева. Например,

Таблица 1 – Основные экономические показатели деятельности ООО «Мир»

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | | |  |
|  |  |  |
|  |  |  |  |  |

Уравнения и формулы следует выделять из текста в отдельную строку

И набирать в специальном редакторе формул, например:

 (1)

Страницы контрольной работы следует нумеровать арабскими цифрами, соблюдая сквозную нумерацию по всему тексту. Номер страницы проставляют в центре нижней части листа без точки. Титульный лист включается в общую нумерацию страниц, но номер страницы на нем не проставляется.

Список возглавляют законодательные, нормативные источники и другие официальные документы в следующем порядке:

– конституции;

– кодексы;

– законы;

– указы Президента;

– постановления Правительства;

Далее список формируется в алфавитном порядке.

Пример оформления учебника:

1. [Кошелев М. Н.](http://www.biblioclub.ru/author.php?action=book&auth_id=22170) Отличительные особенности риск-менеджмента. - М.: Лаборатория книги, 2015. – 416 с. (ЭБС www.biblioclub.ru)

Пример оформления учебного пособия:

2. Демчук О.Н. Риск-менеджмент: учеб. пособие /О.Н. Демчук, Т.А. Ефремова. – М. : Флинта, 2016. – 354 с. (ЭБС www.biblioclub.ru)

Пример оформления статьи:

3.Терёшина Т.Н. Риск-менеджмент на предприятии /Т.Н. Терёшина //Деньги и кредит. – 2015. – No . 12. – С. 54-57.

Пример оформления интернет - ресурса:

4. Веснин В.Р. Риск-иенеджмент [Электронный ресурс] : учебно-практическое пособие / В.Р. Веснин — Электрон. текстовые данные. — Москва: Евразийский открытый институт, 2016. — 336 c. — 978-5-4487-0007-1. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/63198.html>

1. СОДЕРЖАНИЕ И СТРУКТУРА КОНТРОЛЬНОЙ РАБОТЫ

По своей структуре контрольная работа должна включать:

- титульный лист,

- содержание,

- введение,

теоретическую часть,

практическую часть,

- заключение,

- список использованных источников (6-8 наименований, сроком издания не старше 5 лет и ЭБС iprbookshop).

**Титульный лист** является первой страницей и оформляется согласно требованиям (приложение 1).

**Содержание** контрольной работы включает названия разделов и параграфов с указанием страниц, с которых они начинаются. Пункты плана должны полностью соответствовать заголовкам разделов (параграфов) в тексте работы.

Каждый раздел контрольной работы следует начинать с нового листа.

Во **введении** излагается цель и задачи работы, формулируется проблема, кратко описывается структура работы.

**Теоретическая часть** контрольной работы содержит краткий литературный обзор состояния заданного для анализа вопроса.

**Практическая часть.** Основное внимание при выполнении контрольной работы студент должен уделить подготовке ее практической части, которая предполагает принятие им самостоятельных решений в сфере разработки и реализации антикризисного управления на современном предприятии.

В **заключении** приводятся краткие выводы, характеризующие результат самостоятельного изучения темы. Желательно, чтобы студент четко выразил собственное мнение по рассматриваемым аспектам работы.

В конце работы приводится **перечень использованной литературы**, составленный в алфавитном порядке. Он должен быть оформлен в соответствие с общепринятыми библиографическими стандартами. В список включаются только те источники, которые использовались при подготовке контрольной работы и на которые имеются ссылки в работе.

**Приложения** в контрольной работе (иллюстрации, графики, диаграммы, таблицы) должны содержать вспомогательный материал, не включенный в основную часть контрольной работы.

**Теоретическая часть** контрольной работы объемом 5-6 страниц должна содержать краткий литературный обзор состояния заданного для анализа вопроса.

Варианты заданий:

1. Классификация рисков, этапы управления рисками
2. Введение в риск-менеджмент
3. Классификация рисков, этапы управления рисками
4. Особенности выбора стратегии и методы решения управленческих задач
5. Определение «функция полезности»
6. Методы математического прогнозирования и оценки рисков на основе принципа «опоры на собственные силы»
7. Применение вероятностных моделей оценки риска на примере организации лотереи
8. Модели расчета показателей риска банкротства и невозврата кредита в системе антикризисного управления фирмой
9. Анализ природного риска. Критерий Вальда
10. Управление рисками на фондовом рынке
11. Методы управления рисками на фондовом рынке
12. Оценка риска при проведении сделок с заемными средствами
13. Риски и страхование бизнеса. Особые условия договора
14. Определение факторов риска банкротства на основе оценки показателей финансового состояния организации
15. Российские модели оценки вероятности наступления банкротства
16. Зарубежные модели оценки вероятности наступления банкротства

**Практическая часть.** Основное внимание при выполнении контрольной работы студент должен уделить подготовке ее практической части, которая предполагает принятие им самостоятельных решений в сфере антикризисного управления предприятием. Ее объем должен составлять 5-6 страниц.

Практическая часть содержит следующие разделы:

1.Краткое описание методики выполнения задачи по риск-менеджменту.

2. Выполнение расчётов.

3. Выводы и предложения.

3.МЕТОДИКА ВЫПОЛНЕНИЯ ЗАДАНИЯ ПРАКТИЧЕСКОЙ ЧАСТИ

Практическая часть основана на выборе рационального варианта производственной деятельности в условиях риска с использованием теории игр.

Задача: Запроектировать объекты к производству работ с различными параметрами, удовлетворяющих как строителей так и эксплуатационщиков проектируемых объектов при следующих исходных данных:

Таблица 3.1 – Исходные данные к решению задачи

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Наименование показателей | Потребность в ресурсах при выполнении  Работ на объектах | | | | Ресурс которым располагает организация |
| 1 | 2 | 3 | 4 |
| Материальные | 4 | 6 | 3 | 4,5 | 15 |
| Финансовые | 12 | 8 | 9 | 6 | 30 |
| Трудовые | 24 | 36 | 18 | 27 | 75 |
| Прибыль | 20 | 30 | 25 | 35 | - |
| Качество вариантов цементогрунтового основания, в балах | 9 | 8 | 10 | 1й вар. | - |
| 7 | 9 | 8 | 2й вар. |
| 5 | 6 | 9 | 3й вар. |
| - | 1ая техн. | 1ая техн. | 1ая техн. | - | - |
|  |  |  |  |  |  |

1. Определяем целевую функцию из условия максимизации прибыли: ,

где δi – булевые переменные

1. Определяем ограничения задачи:







1. Определяем граничные условия задачи δi=0,1; δi=1 – при выборе объекта к производству работ

δi=0 – при отсутствии работ на объекте.

1. В табличной форме выберем объекты, которые удовлетворяют условию задачи:

Таблица 3.3 – Решение задачи о выборе объектов

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Варианты выбора объектов | Значения булевых переменных | | | | Значения целевых функций и ограничений | | | |
| δ1 | δ2 | Δ3 | δ4 | L | (1) | (2) | (3) |
| 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | 20 | 4 | 12 | 24 |
| 2 | 0 | 1 | 0 | 0 | 30 | 6 | 8 | 36 |
| 3 | 0 | 0 | 1 | 0 | 25 | 3 | 9 | 18 |
| 4 | 0 | 0 | 0 | 1 | 35 | 4,5 | 6 | 27 |
| 5 | 1 | 1 | 0 | 0 | 50 | 10 | 20 | 60 |
| 6 | 0 | 1 | 1 | 0 | 55 | 9 | 17 | 54 |
| 7 | 0 | 0 | 1 | 1 | 60 | 7,5 | 15 | 55 |
| 8 | 1 | 0 | 1 | 0 | 45 | 7 | 21 | 42 |
| 9 | 0 | 1 | 0 | 1 | 65 | 10,5 | 14 | 63 |
| 10 | 1 | 0 | 0 | 1 | 55 | 8,5 | 18 | 51 |
| 11 | 1 | 1 | 1 | 0 | н/д | 13 | 29 | <78> |
| 12 | 0 | 1 | 1 | 1 | н/д | 13,5 | 23 | <81> |

Выберем к производству работ второй и четвертый объекты, так как они принесут максимальную прибыль, равную 65 при выполнении всех ограничений.

1. В табличной форме выберем значение минимакса и максимина, на пересечении которых будет находиться вариант параметров объекта, удовлетворяющий как строителей, так и эксплуатационщиков:

Таблица 3.4 – Выбор варианта параметров объекта в условиях риска

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Конструкция ц/грунтового основания | Технология производства работ | | | Минимакс |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | 9 | 8 | 10 | <8> |
| 2 | 7 | 9 | 8 | 7 |
| 3 | 5 | 6 | 9 | 5 |
| Максимин | 9 | 9 | 10 | - |

При одинаковых значениях максимина выберем тот, который соответствует меньшей стоимости производства работ (принята линейная зависимость – чем выше качество, тем больше стоимость производства работ).

Вывод: К производству работ принимаем второй и четвертый объекты с первой конструкцией, выполненной по второй технологии производства работ.

РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА

# [Алексеенко В. Б.](http://biblioclub.ru/index.php?page=author_red&id=33154), [Кутлыева Г. М.](http://biblioclub.ru/index.php?page=author_red&id=77388), [Мочалова Ю. И.](http://biblioclub.ru/index.php?page=author_red&id=77389) Управление рисками в производственно-хозяйственной деятельности предприятия [Электронный ресурс]: учебно-методическое пособие. - М.: [Российский университет дружбы народов](http://biblioclub.ru/index.php?page=publisher&pub_id=315), 2018. – 88 с. – Режим доступа: [http://www.biblioclub.ru](http://www.biblioclub.ru/)

# [Балдин К. В.](http://biblioclub.ru/index.php?page=author_red&id=8352), [Передеряев И. И.](http://biblioclub.ru/index.php?page=author_red&id=8353), [Голов Р. С.](http://biblioclub.ru/index.php?page=author_red&id=8351) Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия [Электронный ресурс]: учебное пособие. - М.: [Дашков и Ко](http://biblioclub.ru/index.php?page=publisher&pub_id=395), 2018. – 419 с. – Режим доступа: [http://www.biblioclub.ru](http://www.biblioclub.ru/)

# [Воробьев С. Н.](http://biblioclub.ru/index.php?page=author_red&id=19942), [Балдин К. В.](http://biblioclub.ru/index.php?page=author_red&id=8352) Управление рисками [Электронный ресурс]: учебное пособие. - М.: [Юнити-Дана](http://biblioclub.ru/index.php?page=publisher&pub_id=2438), 2017. – 512 с. – Режим доступа: [http://www.biblioclub.ru](http://www.biblioclub.ru/)

1. Рыхтикова, Н.А. Анализ и управление рисками организации: Учебное пособие / Н.А. Рыхтикова. - М.: Форум, 2017. - 240 c.
2. Стребел, П. Грамотные ходы. Как умные стратегия, психология и управление рисками обеспечивают успех бизнеса / П. Стребел, Э. Олссон; Пер. с англ. А. Столяров. - М.: Олимп-Бизнес, 2018. - 208 c.

# [Тепман Л. Н.](http://biblioclub.ru/index.php?page=author_red&id=19463), [Эриашвили Н. Д.](http://biblioclub.ru/index.php?page=author_red&id=19430) Управление рисками в условиях финансового кризиса [Электронный ресурс]: учебное пособие. - М.: [Юнити-Дана](http://biblioclub.ru/index.php?page=publisher&pub_id=2438), 2017. – 296 с. – Режим доступа: [http://www.biblioclub.ru](http://www.biblioclub.ru/)

7. Уродовских, В.Н. Управление рисками предприятия: Учебное пособие / В.Н. Уродовских. - М.: Вузовский учебник, ИНФРА-М, 2017. - 168 c.

ресурсЫ СЕТИ Интернет

1. Электронная библиотечная система IPRbooks - <http://www.iprbookshop.ru>

2. Электронная библиотечная система biblioclub - [http://www.biblioclub.ru](http://www.biblioclub.ru/)

ПРИЛОЖЕНИЕ 1

*Образец оформления титульного листа контрольной работы*

### Частное образовательное учреждение

### высшего образования

Брянский институт управления и бизнеса

### \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Кафедра экономики и управления

**контрольная работа**

Дисциплина: РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ

Выполнил студент … курса

заочной формы обучения

направления подготовки

38.03.02 Менеджмент

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

*ФИО студента*

Проверил:

к.т.н. доцент Токар Н.И.

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

*подпись руководителя*

Брянск 2019