

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Уфимский государственный нефтяной технический университет»

УТВЕРЖДАЮ

Директор УВШЭУ

Гамилова Д. А.

(подпись)

29.06.2023

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

(51818) Управление эффективностью и рисками бизнеса

Направление подготовки (специальность): **38.04.02 Менеджмент**

Направленность: **магистерская программа «Экономика и управление в нефтегазовом бизнесе»**

Уровень высшего образования: **магистратура**

Форма обучения: **очная;**

Кафедра, обеспечивающая преподавание дисциплины: **Уфимская высшая школа экономики и управления (УВШЭУ);**

Трудоемкость дисциплины: **5 з.е. (180час)**

Уфа 2023

Рабочую программу дисциплины разработал(и):

_____ доцент, канд. экон. наук, Тасмуханова Альфия Ерсайиновна

Рецензент

_____ доцент, канд. экон. наук, Герасимова Марина Витальевна

Рабочая программа дисциплины рассмотрена и одобрена на заседании кафедры Уфимская высшая школа экономики и управления (УВШЭУ);, обеспечивающей преподавание дисциплины 24.04.2023, протокол №8.

Заведующий кафедрой

Уфимская высшая школа экономики и управления (УВШЭУ) _____ Гамилова Д. А.

СОГЛАСОВАНО

Заведующий кафедрой УВШЭУ _____ Гамилова Д. А.

Год приема 2023 г.

Рабочая программа зарегистрирована 08.06.2023 № 6 в ОПЛА и внесена в электронную базу данных

1. Место дисциплины в структуре ОПОП ВО

Дисциплины, предшествующие изучению данной дисциплины (исходя из формирования этапов по компетенциям):

Дисциплины, для которых освоение данной дисциплины необходимо как предшествующее (исходя из формирования этапов по компетенциям): Научно-исследовательская работа; Практика по профилю профессиональной деятельности; Производственный менеджмент (Проектный семинар)

Блок: Блок 1. Дисциплины (модули);

Обязательная или часть, формируемая участниками образовательных отношений (в том числе элективные дисциплины): Часть, формируемая участниками образовательных отношений;

Форма обучения: очная

Семестр, в котором преподается дисциплина	Трудоемкость дисциплины				Вид промежу- точной аттестации
	Зачет- ные едини- цы	Часы			
		Общая	В том числе		
			контакт- ная	СРО	
3	5	180	46	134	экзамен;
ИТОГО:	5	180	46	134	

2. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины

№ пп.	Формируемые компетенции	Шифр/ индекс компетен- ции
1	МЭК120-23 Способен анализировать, систематизировать и оценивать эффективность процессной архитектуры нефтегазового бизнеса, разрабатывать инновационные направления и модели оптимизации бизнес-процессов с учетом рисков составляющей в рамках развития и цифровой трансформации производства	ПК-4--1

В результате освоения дисциплины обучающийся должен:

Шифр компетенции	Индикаторы достижения компетенций	Шифр результата обучения	Результат обучения
ПК-4-	ПК-4.2 Формулирует цели и оценивает реальную и потенциальную эффективность производственной деятельности, разрабатывает модели управления рисками	З(ПК-4-)	Знать: Знание методов разработки управленческих решений по повышению эффективности производственной деятельности нефтяных и газовых компаний с учетом фактора неопределенности
		У(ПК-4-)	Уметь: Умение применять различные методы учета и оценки рисков при принятии управленческих решений с целью повышения эффективности производственной деятельности нефтяных и газовых компаний
		В(ПК-4-)	Владеть: Навыки управления рисками, возникающими при реализации управленческих решений по повышению эффективности производственной деятельности нефтяных и газовых компаний

3. Структура дисциплины

3.1. Виды учебной работы и трудоемкость (всего и по семестрам, в часах)

Форма обучения: очная

Вид учебной работы	Всего и по семестрам, часы	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
Контактная работа, всего в том числе:	46			46									
лекции (всего)	12			12									
-в т.ч. лекции on-line курс	0												
практические занятия (ПЗ)	28			28									
-в т.ч. практические занятия on-line курс	0												
лабораторные работы (ЛР)	0												

контролируемая самостоятельная работа (защита курсового проекта, курсовой работы и др. работ (при наличии))	0												
-в т.ч. лабораторные работы on-line курс	0												
иная контактная работа (сдача зачета, экзамена, консультации)	6			6									
проектная деятельность (ПД)	0												
Самостоятельная работа обучающихся (СРО), всего в том числе: (указать конкретный вид СРО)	134			134									
выполнение и подготовка к защите курсового проекта или курсовой работы	0												
выполнение и подготовка к защите РГР работы, реферата, патентных исследований, аналитических исследований и т.п	15			15									
изучение учебного материала, вынесенного на самостоятельную проработку	46			46									
подготовка к лабораторным и/или практическим занятиям	50			50									
подготовка к сдаче зачета, экзамена	23			23									
иные виды работ обучающегося (при наличии)	0												
освоение on-line курса	0												
самостоятельная проектная деятельность (СПД)	0												
ИТОГО ПО ДИСЦИПЛИНЕ	180			180									

4. Содержание дисциплины

4.1. Темы (разделы) дисциплины и виды занятий (в часах)

Форма обучения: очная

(раздела)Номер темы	Название темы (раздела)	Семестр	Трудоемкость, часы					Шифр результата обучения
			Л	ПЗ	ЛР	СРО	Всего	
1	Теоретические основы управления эф-	3	6	12		52	70	З(ПК-4-) У(ПК-4-) В(ПК-

Номер темы	Назва- ние	Семес- тр	Трудоемкость, часы					Шифр ре-
			Л	ПЗ	ЛР	СРО	Всего	
	эффектив- ностью бизнеса. Ключе- вые по- казатели эффек- тивно- сти							4-)
2	Основы риск- мене- джмен- та. Оценка и управ- ление рисками бизнеса	3	6	16		82	104	З(ПК- 4-) У(ПК- 4-) В(ПК- 4-)
	ИТОГО:		12	28		134	174	

4.2. Содержание лекционного курса

№ пп.	Номер раздела	Название темы	Трудоемкость, часы		
			очная	очно- заочная	заочная
1	1-Теоретические основы управления эффективностью бизнеса. Ключевые показатели эффек- тивности	Концепция управления эф- фективностью и основные инструмен-ты управления эф- фективностью компаний Концепция управления эф- фективностью бизнеса. Основ- ные элемен-ты управления эф- фективностью. Развитие систем управления эф- фективностью. Цикл управления эффективностью. Инструменты управления эф- фективностью. Место управле- ния эффектив- ностью бизнеса в организационной структуре компа-	2		

		нии. Препятствия на пути развития систем управления эффективностью бизнеса в компании. Культура управления эффективностью. Система управления эффективностью.			
2	1-Теоретические основы управления эффективностью бизнеса. Ключевые показатели эффективности	Ключевые показатели эффективности как базовый элемент системы управления эффективностью Понятие ключевых показателей эффективности: ключевые показатели результативности, производственные показатели, ключевые показатели эффективности. Характеристики ключевых показателей эффективности. Определение набора показателей и ключевых показателей эффективности компании. Механизм определения ключевых показателей эффективности. Механизм внедрения ключевых показателей эффективности. Организационное обеспечение внедрения системы управления результатами бизнеса. Служба контроллинга компании.	2		
3	1-Теоретические основы управления эффективностью бизнеса. Ключевые показатели эффективности	Сбалансированная система показателей как базовый инструмент реализации корпоративной стратегии Появление кон-	2		

		цепции сбалансированной системы показателей. Структура сбалансированной системы показателей. Перспективы сбалансированной системы показателей. Использование стратегических карт при разработке сбалансированной системы показателей. Управление на основе сбалансированной системы показателей. Взаимосвязь показателей эффективности			
1	2-Основы риск-менеджмента. Оценка и управление рисками бизнеса	Критический обзор существующих методов оценки и анализа рисков Предпринимательские потери и зоны риска. Возникновение рисков при постановке миссии и целей бизнеса. Математические модели оценки риска. Абсолютные и относительные показатели оценки риска. Система критериев принятия рискованного решения. Качественные и количественные методы оценки риска. Вероятностные показатели оценки риска. Статистические показатели оценки риска. Экспертные оценки риска	2		
3	2-Основы риск-менеджмента. Оценка и управление рисками бизнеса	Основные методы управления рисками Общие вопросы развития управления рисками. Механизмы ней-	2		

		трализации риска. Приемы снижения степени риска. Распределение и диссипация риска. Локализация источников риска. Диверсификация риска. Страхование риска. Хеджирование риска. Методы компенсации риска. Методы финансирования рисков			
4	2-Основы риск-менеджмента. Оценка и управление рисками бизнеса	Функции риска. Классификация рисков нефтегазового бизнеса Стадии развития, функции и черты риска. Терминология и аксиомы риск-менеджмента. Организация риск-менеджмента на координирующем и исполнительном уровнях. Выявление факторов риска. Особенности группировки рисков нефтегазовой промышленности. Общая классификация рисков. Случайные факторы риска. Внешние (объективные) факторы риска. Внутренние (субъективные) факторы риска	2		
	-	ИТОГО:	12		

4.4. Перечень практических занятий

Номер раздела	№ ПЗ	Трудоемкость, часы
---------------	------	--------------------

			очная	очно- заочная	заочная
1-Теоретические основы управления эффективностью бизнеса. Ключевые показатели эффективности	1	Разработка системы ключевых показателей эффективности компании В ходе решения кейса студенты разрабатывают систему ключевых показателей эффективности компании двумя способами: на основе определения системы стратегических целей и критических факторов успеха; на основе выделения бизнес-процессов компании	4		
1-Теоретические основы управления эффективностью бизнеса. Ключевые показатели эффективности	2	Разработка ключевых показателей эффективности для подразделений компании На базе результатов, полученных студентами в результате решения кейса «Разработка ключевых показателей эффективности компании», студенты получают задание разработать набор ключевых показателей для нескольких подразделений анализируемой компании. Студенты самостоятельно выбирают подход к	4		

		разработке ключевых показателей эффективности подразделения: на основе сбалансированной системы показателей, на основе показателей результативности бизнес-процесса.			
1-Теоретические основы управления эффективностью бизнеса. Ключевые показатели эффективности	3	Разработка стратегической карты эффективности бизнеса Студенты определяют взаимосвязь между разработанными ранее показателями сбалансированной системы, анализируют достижение плановых показателей, формируют стратегическую карту ССП	4		
2-Основы риск-менеджмента. Оценка и управление рисками бизнеса	1	Количественные и качественные методы оценки рисков Студенты учатся строить дерево решений и выбирать на его основе наиболее целесообразный вариант проекта с точки зрения экономической эффективности, анализируют риски отдельных стадий инвестиционного проекта методом экспертных оценок, закрепляют навыки оценки рисков с помощью математических	6		

		критериев эффективности в условиях определенности и неопределенности			
2-Основы риск-менеджмента. Оценка и управление рисками бизнеса	2	Анализ рисков методами анализа чувствительности и анализа сценариев Студенты учатся проводить анализ чувствительности к изменяемым рисковым параметрам, разрабатывать варианты пессимистического, оптимистического и наиболее вероятного сценариев реализации проекта с учетом рисков	4		
2-Основы риск-менеджмента. Оценка и управление рисками бизнеса	3	Методический подход к оценке рисков в системе планирования нефтегазодобывающих предприятий Студенты реализуют на практическом примере алгоритм оценки рисков при долгосрочном планировании добычи и реализации нефти и газа, включающий поэтапную оценку геологических, внутренних производственных и экологических рисков, а также учет варьируемых факторов внешней среды	6		
-		ИТОГО:	28		

--	--	--	--	--	--

4.5. Виды СРО

Номер раздела	Вид СРО	Трудоемкость, часы		
		очная	очно-заочная	заочная
1-Теоретические основы управления эффективностью бизнеса. Ключевые показатели эффективности	подготовка к сдаче зачета, экзамена	10		
1-Теоретические основы управления эффективностью бизнеса. Ключевые показатели эффективности	подготовка к лабораторным и/или практическим занятиям	22		
1-Теоретические основы управления эффективностью бизнеса. Ключевые показатели эффективности	изучение учебного материала, вынесенного на самостоятельную проработку	20		
2-Основы риск-менеджмента. Оценка и управление рисками бизнеса	подготовка к сдаче зачета, экзамена	13		
2-Основы риск-менеджмента. Оценка и управление рисками бизнеса	подготовка к лабораторным и/или практическим занятиям	28		
2-Основы риск-менеджмента. Оценка и управление рисками бизнеса	изучение учебного материала, вынесенного на самостоятельную проработку	26		
2-Основы риск-менеджмента. Оценка и управление рисками бизнеса	выполнение и подготовка к защите РГР работы, реферата, патентных исследований, аналитических исследований и т.п	15		
-	ИТОГО:	134		

Темы для самостоятельной работы обучающихся

Раздел 1. Теоретические основы управления эффективностью бизнеса. Ключевые показатели эффективности

1) Эволюция концепции управления эффективностью бизнеса: оценка заслуг, управление по целям, метод критических инцидентов, поведенческая рейтинговая шкала и др.

- 2) Внедрение концепции управления эффективностью: этапы внедрения концепции управления эффективностью, интеграция системы управления эффективностью, интеграция управления эффективностью с обучением персонала.
- 3) Внедрение сбалансированной системы показателей в деятельность компании.
- 4) Информационные продукты поддержки сбалансированной системы показателей

Раздел 2. Основы риск-менеджмента. Оценка и управление рисками бизнеса

- 1) Концепция рискованности стоимости.
- 2) Влияние факторов эластичности предложения и спроса на уровень риска.
- 3) Влияние фактора налогообложения в рыночном равновесии на уровень риска.
- 4) Общие группы источников информации при анализе конкретных рисков.
- 5) Нормальное распределение вероятностей и кривая рисков.

5. Формы текущего контроля успеваемости и проведения промежуточной аттестации

Перечень оценочных средств текущего контроля и промежуточной аттестации по дисциплине приведен Фонде оценочных средств (приложение Б).

6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

6.1. Учебно-методическое обеспечение

Сведения об обеспеченности дисциплины основной, дополнительной и учебно-методической литературой приведены в формах № 1-УЛ и № 2-УЛ (приложение А).

6.2. Перечень современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем, рекомендуемых для освоения дисциплины

Названия современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем, рекомендуемых для освоения дисциплины	Ссылки на официальные сайты
Информационно-правовой портал Гарант.ру	http://www.garant.ru/
Консультант-плюс	http://www.consultant.ru/
Министерство экономического развития Российской Федерации	http://economy.gov.ru/minrec/main
Министерство энергетики Российской Федерации	https://minenergo.gov.ru
Российская государственная библиотека	https://www.rsl.ru/
Сайт бизнес-кейсов	http://www.e-xecutive.ru
ЭБС Znanium.com	http://znanium.com/
ЭБС Лань	https://e.lanbook.com/
ЭБС Национальная электронная библиотека	https://rusneb.ru/
ЭБС «Университетская библиотека онлайн»	https://biblioclub.ru/
Электронная библиотека УГНТУ	http://www.bibl.rusoil.net

7. Материально-техническое обеспечение дисциплины

7.1. Перечень специальных аудиторий, кабинетов, лабораторий и пр., используемых при реализации дисциплины с перечнем основного оборудования

№ пп.	Номер помещения	Оснащенность помещения (перечень основного оборудования)	Наименование помещения
1	1-420в	Компьютер Intel Core 2 Duo E8200(1);Компьютер WIN i3-550(2);Компьютер персональный i3-4170/21,5" PHILIPS 226V4LAB(1);МФУ hp Laser Jet Pro M1536dnf<CE538A>A4(1);Монитор 19" Acer(1);Монитор ASUS VA24DQ Black 23,8", шт(3);Сервисное устройство для очистки Katun 3 м(1);Системный блок CRONA:i7 11700/DDR4 2*16GB/SSD 250Gb Samsung/HDD 1Tb/600W(3);Шкаф(ы) для хранения	Помещения для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования
2	2в-201	Компьютер 6 ПЭВМ Кламас/23,8" LG монитор/клавиатура+мышьLogitech (4);Моноблок HP ProOne 440 G6 All-in-One 23,8" i3(7);Профессиональный камкордер Sony HXR-NX70P(1);Система видеоконференц-связи Yealink(1);Телевизор 70" LG 70UM7100(1);Столы, стулья	Учебная аудитория для текущего контроля и промежуточной аттестации – укомплектована специализированной (учебной) мебелью, техническими средствами обучения.
3	2в-203	Компьютер i3-3220 K1 BenQ 21,5"(1);Монитор 17" Acer AL 1717(1);Монитор 19" Acer AL 1917 NSD(1);Проектор EPSON EB-970 (V11H865040)(1);Проектор Sony VPL-CX125 LCD(1);Системный блок 3 ПЭВМ Кламас Powerman 450W\i3-7100\GT 730 2048Mb(1);Системный блок INWIN 450W\i3-7100Box\Asus H110M-R(2);Системный блок INWIN EC022 450W\i3-7100\ASUS H110M-R(3);Экран настенный ScreenMedia Champion 203*153(1);Экран с электропривод. (1);Экран с электроприводом DRAPER 120"(1);Столы, стулья	Учебная аудитория для проведения групповых и индивидуальных консультаций
4	2в-204	Компьютер 2 ПЭВМ Кламас/21,5" LG монитор/клавиатура+мышьLogitech (25);Проектор мультимедийный NEC Projector M363XG 1024*768(1);Системный блок Intel Core 2 DUO(4);Экран Projecta ProScreen настенный рулонный 183*240(1);Столы, стулья	Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа – укомплектована специализированной (учебной) мебелью, техническими средствами обучения.
5	2-217	Компьютер i3-2100(1);Проектор EPSON Projector EB-2040(1);Экран с электроприводом ScreenMedia Champion SCM-4305(1);Учебно-наглядные пособия по дисциплине,набор демонстрационного оборудования; Столы, стулья;	Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа – укомплектована специализированной (учебной) мебелью, набором демонстрационного оборудования и учебно-наглядными пособиями, обеспечивающими тематические иллюстрации, соот-

7.2. Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, используемых в учебном процессе при освоении дисциплины

№ пп.	Наименование ПО	Лицензионная чистота (реквизиты лицензии, свидетельства о гос. регистрации и т.п., срок действия)
1	ABBYY FineReader	Дата выдачи лицензии 17.12.2013, Поставщик: ЗАО "СофтЛайн Трейд"
2	FineReader	Дата выдачи лицензии 10.12.2009, Поставщик: ЗАО "СофтЛайн Трейд"
3	Microsoft Office	Дата выдачи лицензии 24.09.2018, Поставщик: ООО "Софтлайн Проекты"
4	Microsoft Office	Дата выдачи лицензии 01.01.2007
5	Windows Professional 10	Дата выдачи лицензии 08.12.2015, Поставщик: ООО "Софтлайн Проекты"
6	Консультант-плюс	Дата выдачи лицензии 01.01.2000, Поставщик: ООО Компания Права "Эксперт"

8. Организация обучения лиц с ограниченными возможностями здоровья

Для лиц с ограниченными возможностями здоровья, обучающихся по данной образовательной программе, разрабатывается индивидуальная программа освоения дисциплины с учетом особенностей их психофизического развития, их индивидуальных возможностей и состояния здоровья.

Приложение А

Форма № УЛ-1

СВЕДЕНИЯ

об обеспеченности дисциплины основной и дополнительной учебной литературой

Наименование дисциплины: (51818)(51818)Управление эффективностью и рисками бизнесаНаправление подготовки (специальность): 38.04.02 МенеджментНаправленность: магистерская программа «Экономика и управление в нефтегазовом бизнесе»Форма обучения: очная;Кафедра, обеспечивающая преподавание дисциплины: Уфимская высшая школа экономики и управления (УВШЭУ);

Тип	Назначение учебных изданий	Семестр			Библиографическое описание	Кол-во экз.	Адрес нахождения электронного	Кoeffициент
		очная	очно-заочная	заочная				
1	2	3	4	5	6	7	8	9
Основная литература	Для изучения теории;	3			Сайфуллина, С. Ф. Инструменты управления эффективностью компании (в схемах и таблицах) : учебное пособие / С. Ф. Сайфуллина ; УГНТУ. - Уфа : Изд-во УГНТУ, 2016. - 74 с. - Текст : непосредственный	41	-	1.00

Основная литература	Для изучения теории;	3			Тасмуханова, А. Е. Оценка и управление рисками : учебное пособие / А. Е. Тасмуханова ; УГНТУ, каф. ЭНГП. - Уфа : Изд-во УГНТУ, 2011. - 142 с. - Текст : непосредственный	111	-	1.00
Дополнительная литература	Для выполнения СРО; Для выполнения практических занятий;	3			Улина, С. Л. Модель управления эффективностью предприятия энергетического комплекса / С. Л. Улина, Е. Н. Хлебников ; Сибирский федеральный университет. – Красноярск : Сибирский федеральный университет (СФУ), 2014. – 142 с. – URL: https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=435629 (дата обращения: 17.01.2022). – Текст : электронный.	1	http://bibl.rusoil.net	1.00
Дополнительная литература	Для выполнения СРО; Для изучения теории;	3			Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент : учебник / А. Н. Фомичев. - 10-е изд. - Москва : Дашков и К, 2023. - 366 с. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/2084174 (дата обращения: 29.09.2023).	1	http://www.e-libbook.com	1.00
Примечание – Графы 1-5,8 заполняются кафедрой, графы 7 и 9 - библиотекой								

Составил:

_____ доцент, канд. экон. наук, Тасмуханова Альфия Ерсайиновна

Год приема 2023 г.

СВЕДЕНИЯ**об обеспеченности дисциплины учебно-методическими изданиями**Наименование дисциплины: (51818)(51818)Управление эффективностью и рисками бизнесаНаправление подготовки (специальность): 38.04.02 МенеджментНаправленность магистерская программа «Экономика и управление в нефтегазовом бизнесе»Форма обучения очная;Кафедра, обеспечивающая преподавание дисциплины: Уфимская высшая школа экономики и управления (УВШЭУ);

Назначение учебных изданий	Семестр			Библиографическое описание	Кол-во экз.		Адрес нахождения электронного	Коэффициент
	очная	очно-заочная	заочная		Всего	в том числе		
1	2	3	4	5	6	7	8	9
Для выполнения практических занятий;	3			Инструменты управления эффективностью компании : учебно-методическое пособие к проведению практических занятий / УГНТУ, каф. ЭНГП ; сост. С. Ф. Сайфуллина. - Уфа : УГНТУ, 2016. - 416 КБ. - URL: http://bibl.rusoil.net/base_docs/UGNTU/ENGP/Saifullina5.pdf . - Текст : электронный.	1	0	http://bibl.rusoil.net	1.00

Для выполнения практических занятий;	3			Оценка и управление рисками : учебно-методическое пособие по выполнению практических работ / УГНТУ, каф. ЭНГП ; сост. А. Е. Тасмуханова. - Уфа : УГНТУ, 2017. - 1,68 Мб. - URL: http://bibl.rusoil.net/base_docs/UGNTU/ENGP/Tasmukhanova18.pdf . - Текст : электронный.	1	0	http://bibl.rusoil.net	1.00
Примечание – Графы 1-5,8 заполняются кафедрой, графы 6,7 и 9 - библиотекой								

Составил:

_____ доцент, канд. экон. наук, Тасмуханова Альфия Ерсайновна

Год приема 2023 г.

Приложение Б

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования
«Уфимский государственный нефтяной технический университет»

УТВЕРЖДАЮ

Директор УВШЭУ

_____ Гамилова Д. А.
29.06.2023

**Фонд оценочных средств по текущей успеваемости и промежуточной аттестации по дисциплине
(51818) Управление эффективностью и рисками бизнеса**

Направление подготовки (специальность): 38.04.02 Менеджмент

Направленность: магистерская программа «Экономика и управление в нефтегазовом бизнесе»

Уровень высшего образования: магистратура

Форма обучения: очная

Кафедра, обеспечивающая преподавание дисциплины: Уфимская высшая школа экономики и управления (УВШЭУ);

Трудоемкость дисциплины: 5 з.е. (180час)

Уфа 2023

ФОС по текущей успеваемости и промежуточной аттестации по дисциплине разработал (и):

_____ доцент, канд. экон. наук, Тасмуханова Альфия Ерсайновна

—
Рецензент

_____ доцент, канд. экон. наук, Герасимова Марина Витальевна

—

ФОС по текущей успеваемости и промежуточной аттестации по дисциплине рассмотрен и одобрен на заседании кафедры Уфимская высшая школа экономики и управления (УВШЭУ);, обеспечивающей преподавание дисциплины 24.04.2023, протокол №8.

Заведующий кафедрой Уфимская высшая школа экономики и управления (УВШЭУ); _____ Гамилова Д. А.

СОГЛАСОВАНО

Заведующий кафедрой УВШЭУ _____ Гамилова Д. А.

Год приема 2023 г.

ФОС по текущей успеваемости и промежуточной аттестации по дисциплине
зарегистрирован 08.06.2023 № 6 в отделе МСОП и внесен в электронную базу данных

1. Паспорт фонда оценочных средств

№ п/п	Контролируемые разделы (темы) дисциплины	Шифр результата обучения	Результат обучения	Индикатор достижения компетенций	Показатели достижения результатов освоения компетенций	Вид оценочного средства
1	Теоретические основы управления эффективностью бизнеса. Ключевые показатели эффективности	В(ПК-4-)	Знание методов разработки управленческих решений по повышению эффективности производственной деятельности нефтяных и газовых компаний с учетом фактора неопределенности	ПК-4.2 Формулирует цели и оценивает реальную и потенциальную эффективность производственной деятельности, разрабатывает модели управления рисками	Владение навыками формирования структуры сбалансированной системы показателей, реализации корпоративной стратегии на основе ключевых показателей эффективности	Письменный и устный опрос Разноуровневые задачи и задания
		З(ПК-4-)		ПК-4.2 Формулирует цели и оценивает реальную и потенциальную эффективность производственной деятельности, разрабатывает модели управления рисками	Знание механизма определения ключевых показателей эффективности, методов построения системы сбалансированных показателей	Письменный и устный опрос Тестирование
		У(ПК-4-)		ПК-4.2 Формулирует цели и оценивает реальную и потенциальную эффективность производственной деятельности, разрабатывает модели управления рисками	Умение разрабатывать варианты и обосновывать целесообразность применения различных инструментов управления эффективностью для решения выявленных проблем	Письменный и устный опрос Разноуровневые задачи и задания
4	Основы риск-менеджмента. Оценка и управление	В(ПК-4-)		ПК-4.2 Формулирует цели и оценивает реаль-	Способность обосновывать выбор метода	Письменный и

	рисками бизнеса			ную и потенциальную эффективность производственной деятельности, разрабатывает модели управления рисками	управления рисками в программах повышения эффективности деятельности для компаний нефтегазовой промышленности	устный опрос Разноуровневые задачи и задания Тестирование
		З(ПК-4-)		ПК-4.2 Формулирует цели и оценивает реальную и потенциальную эффективность производственной деятельности, разрабатывает модели управления рисками	Знание критериев принятия управленческих решений, методов оценки эффективности проектов с учетом фактора неопределенности	Письменный и устный опрос Реферат Тестирование
		У(ПК-4-)		ПК-4.2 Формулирует цели и оценивает реальную и потенциальную эффективность производственной деятельности, разрабатывает модели управления рисками	Умение применять методы математической статистики и экспертной оценки для учета фактора риска при принятии управленческих решений, с помощью количественных и качественных методов оценивать уровень риска	Письменный и устный опрос Разноуровневые задачи и задания

2. Перечень оценочных средств для текущего контроля и промежуточной аттестации по дисциплине

п/п	Вид оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в фонде	Шкала оценки
1	2	3	4	5

1	Письменный и устный опрос	Оценочное средство для текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации. Позволяет выявить и восполнить пробелы в знаниях; повторить, закрепить, систематизировать материал; оценить знания, умения, теоретические и практические навыки; определить уровень сформированных у студентов компетенций по дисциплине (модулю)	Совокупность вопросов, заданий, упражнений, тестов для выполнения контрольных работ, домашних заданий, РГР и иных учебных работ. Комплект билетов для текущей и промежуточной аттестации	оценка « <i>отлично</i> » выставляется обучающемуся, если студент дал полные правильные ответы на все три вопроса в билете и положительные ответы на дополнительные вопросы преподавателя оценка « <i>хорошо</i> » выставляется обучающемуся, если студент дал полные правильные ответы на два вопроса в билете и положительные ответы на дополнительные вопросы преподавателя оценка « <i>удовлетворительно</i> » выставляется обучающемуся, если студент дал полный правильный ответ хотя бы на один вопрос в билете и положительно ответил на дополнительные вопросы преподавателя оценка « <i>неудовлетворительно</i> » выставляется обучающемуся, если студент неправильно ответил на все вопросы в билете и неверно ответил на дополнительные вопросы преподавателя
2	Разноуровневые задачи и задания	Различают задачи и задания: а) репродуктивного уровня, позволяющие оценивать и диагностировать знание фактического материала (базовые понятия, алгоритмы, факты) и умение правильно использовать специальные термины и понятия, узнавание объектов изучения в рамках определенного раздела дисциплины; б) реконструктивного уровня, позволяющие оценивать и диагностировать умения синтезировать, анализировать, обобщать фактический и теоретический материал с формулированием конкретных выводов, установлением причинно-следственных связей; в) творческого уровня, позволяющие оценивать и диагностиро-	Комплект разноуровневых задач и заданий	оценка « <i>отлично</i> » выставляется обучающемуся, если студент умеет правильно выбрать необходимые формулы для расчета экономических показателей и получает верные результаты с их использованием оценка « <i>хорошо</i> » выставляется обучающемуся, если студент может свободно ориентироваться в формулах для расчета экономических показателей, но результаты расчетов могут иметь ошибки оценка « <i>удовлетворительно</i> » выставляется обучающемуся, если студент не умеет самостоятельно выбрать необходимую формулу для расчета экономических показателей, но может проводить по ним расчеты оценка « <i>неудовлетворительно</i> » выставляется обучающемуся, если студент не умеет проводить расчеты экономических показателей с использованием формул

		вать умения, интегрировать знания различных областей, аргументировать собственную точку зрения.		
3	Реферат	Продукт самостоятельной работы обучающегося, представляющий собой краткое изложение в письменном виде полученных результатов теоретического анализа определенной научной (учебно-исследовательской) темы, где автор раскрывает суть исследуемой проблемы, приводит различные точки зрения, а также собственные взгляды на нее.	Темы рефератов, требования к их защите	оценка «<i>отлично</i>» выставляется обучающемуся, если в реферате в методической части рассмотрены имеющиеся работы отечественных и зарубежных авторов по теории анализируемых проблем и возможных направлений их решения. Вторая часть реферата носит практический характер. В ней рассмотрен случай применения описываемой модели или подхода в практике предприятий оценка «<i>хорошо</i>» выставляется обучающемуся, если в реферате в методической части рассмотрены имеющиеся работы отечественных и зарубежных авторов по теории анализируемых проблем и возможных направлений их решения. Вторая часть реферата носит практический характер, сделана попытка раскрыть суть применения описываемой модели или подхода в практике предприятий оценка «<i>удовлетворительно</i>» выставляется обучающемуся, если в реферате не до конца раскрыта изучаемая тема с использованием материалов отечественных и зарубежных авторов по теории и практике анализируемых проблем и возможных направлений их решения. Случай применения описываемой модели или подхода в практике предприятий не соответствует заявленной теме оценка «<i>неудовлетворительно</i>» выставляется обучающемуся, если в реферате абсолютно не раскрыта изучаемая тема с использованием материалов отечественных и зарубежных авторов по теории и практике анализируемых проблем и возможных направлений их решения, не рассмотрен случай применения описываемой модели или подхода в практике предприятий
4	Тестирование	Система стандартизированных простых и комплексных заданий, позволяющая автоматизировать процедуру измерения уровня знаний, умений и владений обучающегося.	Фонд тестовых заданий.	оценка «<i>отлично</i>» выставляется обучающемуся, если студент верно ответил более чем на 90% вопросов оценка «<i>хорошо</i>» выставляется обучающемуся, если студент верно ответил более чем на 80% вопросов оценка «<i>удовлетворительно</i>» выставляется обучающемуся, если студент верно ответил более чем на 70% вопросов оценка «<i>неудовлетворительно</i>» выставляется обучающемуся, если студент верно ответил менее чем на 70% вопросов

Приложение В

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования
«Уфимский государственный нефтяной технический университет»

Письменный и устный опрос.

Перечень вопросов (задач, заданий, тем, комплекта тестовых заданий):

Перечень вопросов (задач, заданий, тем, комплекта тестовых заданий):

Уфимский государственный нефтяной технический университет
Уфимская высшая школа экономики и управления (УВШЭУ)

Экзаменационный билет № 1

по дисциплине «Управление эффективностью и рисками бизнеса»

Направление подготовки: 38.03.02 Менеджмент. Направленность: Экономика и управление в нефтегазовом бизнесе

- 1 Основные элементы управления эффективностью
- 2 Общая классификация рисков. Случайные факторы риск
- 3 Экспертные оценки риска

Директор УВШЭУ

Д.А. Гамилова

Дата

Лектор

А.Е. Тасмуханова

Дата

Уфимский государственный нефтяной технический университет
Уфимская высшая школа экономики и управления (УВШЭУ)

Экзаменационный билет № 2

по дисциплине «Управление эффективностью и рисками бизнеса»

Направление подготовки: 38.03.02 Менеджмент. Направленность: Экономика и управление в нефтегазовом бизнесе

- 1 Механизм внедрения ключевых показателей эффективности
- 2 Количественные методы оценки риска
- 3 Методы компенсации риска

Директор УВШЭУ

Д.А. Гамилова

Дата

Лектор

А.Е. Тасмуханова

Дата

При оценке знаний студентов учитывается как объем знаний, так и качество их усвоения, понимание дисциплины, место каждой темы во всем курсе, ее связи с предыдущими и последующими темами, оцениваются умение свободно, грамотно, логически стройно излагать изученное, способность защищать свою точку зрения, доказывать, убеждать, вести полемику.

В билете предусмотрено три теоретических вопроса из следующего перечня:

1. Концепция управления эффективностью бизнеса.
2. Основные элементы управления эффективностью.

3. Цикл управления эффективностью.
4. Инструменты управления эффективностью.
5. Место управления эффективностью бизнеса в организационной структуре компании.
6. Понятие ключевых показателей эффективности: ключевые показатели результативности, производственные показатели, ключевые показатели эффективности.
7. Определение набора показателей и ключевых показателей эффективности компании.
8. Механизм определения ключевых показателей эффективности.
9. Механизм внедрения ключевых показателей эффективности.
10. Появление концепции сбалансированной системы показателей.
11. Структура сбалансированной системы показателей.
12. Использование стратегических карт при разработке сбалансированной системы показателей.
13. Стадии развития, функции и черты риска.
14. Терминология и аксиомы риск-менеджмента.
15. Организация риск-менеджмента на координирующем уровне, на исполнительном уровне.
16. Особенности группировки рисков нефтегазовой промышленности.
17. Общая классификация рисков. Случайные факторы риска.
18. Внешние (объективные) факторы риска.
19. Внутренние (субъективные) факторы риска.
20. Классификация рисков по их функциональной направленности.
21. Качественные методы оценки риска.
22. Количественные методы оценки риска.
23. Абсолютные и относительные показатели оценки риска.
24. Вероятностные показатели оценки риска.
25. Статистические показатели оценки риска.
26. Экспертные оценки риска.
27. Концепция рисковой стоимости
28. Критерии принятия решения в условиях определенности: пригодности, оптимальности, адаптивности
29. Критерии принятия решения в условиях стохастической и нестохастической неопределенности
30. Механизмы нейтрализации риска.
31. Приемы снижения степени риска.
32. Распределение и диссипация риска.
33. Локализация источников риска.
34. Диверсификация риска.
35. Страхование риска.
36. Хеджирование риска.
37. Методы компенсации риска.
38. Методы финансирования рисков и схема их классификации.
39. Зарубежный опыт управления рисками.
40. Оценивание результативности нейтрализации и организация мониторинга рисков.

1. Экспертные оценки риска.

Экспертные методы подразделяются на индивидуальные и коллективные.

К индивидуальным относятся, например, метод «интервью», аналитические докладные записки, написание сценария. Индивидуальные методы предполагают полностью независимую работу каждого из экспертов над решением поставленной проблемы.

В методе «интервью» эксперт опрашивается по специально разработанной программе (опросному листу). Цель задаваемых ему вопросов состоит в выявлении: потенциальных источников опасности и экстремальных условий их функционирования; событий, инициирующих аварии и катастрофы; факторов, способствующих эскалации аварии; факторов безопасности; исходов аварий, ката-

строф и их последствий.

Составление аналитических экспертных записок включает самостоятельную работу эксперта над анализом ситуации. Результатом его работы является докладная записка с обоснованием возможности проявления неблагоприятного события и нанесения ущерба, принимая во внимание отмеченные выше факторы опасности и безопасности и их «вес».

Как модификацию аналитической экспертной записки можно рассматривать написание сценария зарождения и развития неблагоприятного события, нанесения ущерба различным объектам, хотя эта процедура по спектру используемых методов может быть значительно шире. В основе сценария лежит установление и описание реальной логической последовательности ситуаций, которые приведут к возникновению ущерба. Методика его написания обычно требует привязки предпосылок (этапов) формирования неблагоприятного события к определенным периодам времени. При этом должны учитываться возможности применения мер по предупреждению этих предпосылок, снижению ущерба от события и т.п.

Разработка сценария предполагает необходимость детального исследования взаимосвязей между явлениями, факторами, обуславливающими возникновение неблагоприятных событий и их воздействия на объекты, которые могут быть упущены на абстрактном уровне их анализа.

Как модификация метода «интервью» может рассматриваться анкетирование населения, проживающего, как правило, вблизи источника потенциальной опасности. Вопросы анкет обычно направлены, например, на выявление причин беспокойства людей относительно ухудшения качества окружающей среды. Они помогают установить приоритетные направления снижения различных рисков, выявить причины ухудшения здоровья у отдельных индивидуумов и их групп, уточнить особенности контактов населения с загрязняющими веществами и проверить эффективность действующих мер по их предотвращению и снижению продолжительности воздействия.

Разновидностью экспертного метода является метод Дельфи. Он характеризуется анонимностью и управляемой обратной связью. Анонимность членов комиссии обеспечивается путем их физического разделения, что не дает им возможности обсуждать ответы на поставленные вопросы. Цель такого разделения – избежать «ловушек» группового принятия решения, доминирования мнения лидера. После обработки результата через управляемую обратную связь обобщенный результат сообщается каждому члену комиссии. Основная цель такого действия – позволить ознакомиться с оценками других членов комиссии, не подвергаясь давлению из-за знания того, кто конкретно дал ту или иную оценку.

Мозговая атака «брейнсторминг» – это форма стимулирования творческой активности работников, средство использования интеллектуальных способностей, когда участникам работы предлагается высказать максимум вариантов управленческого решения, из которых отбираются самые удачные для использования на практике.

Технически это осуществляется следующим образом: приглашается группа экспертов как работающих на предприятии, так и извне. Создаются две группы: участники, которые должны предложить новые варианты решения поставленной задачи, и комиссия, обрабатывающая предложенные идеи. В группе генерирования идей люди не должны быть связанными отношениями подчинения – из-за этого может не сложиться атмосфера доверия и творчества. Суть решаемой проблемы обозначена заранее. При проведении мозговой атаки участники не должны бояться, что их высказывания не представляют ценности. Предложения запрещено оценивать негативно ни словом, ни жестом, ни интонацией. Желательно их развитие в открытой и свободной обстановке. Чем больше идей, тем лучше. Обычно руководитель собирает группу в отведенном для нее помещении и еще раз подробно формулирует задачу. Поступившие предложения регистрируются и передаются в комиссию. Все длится около 2-3 часов. Выбранные идеи поступают в практическую разработку

2. Критерии принятия решения в условиях стохастической и нестохастической неопределенности

Если проектные решения принимаются в условиях неопределенности, то для выбора наиболее рационального из них рекомендуется использовать критерии Вальда, Сэвиджа и Гурвица. Максимальный критерий Вальда представляет собой критерий крайнего пессимизма. С позиции данного критерия из всех самых неудачных результатов выбирается лучший.

а) критерий Вальда $W = \max \min B_{ij}$

б) критерий Сэвиджа $S = \min \max R_{ij}$

в) критерий Гурвица $H = \max [\alpha \min B_{ij} + (1-\alpha) \max B_{ij}]$

Критерий минимаксного риска Сэвиджа также пессимистичен. Выбор стратегии аналогичен выбору стратегии по принципу Вальда с тем отличием, что в качестве результатов рассматриваются не выигрыши, а риски. По критерию Сэвиджа выбирается минимально возможный из самых крупных рисков.

Критерий пессимизма-оптимизма Гурвица при выборе решения рекомендует руководствоваться некоторым средним результатом, характеризующим состояние между крайним пессимизмом и безудержным оптимизмом.

В формуле критерия Гурвица присутствует коэффициент α , значение которого устанавливается в зависимости от степени уверенности лица, принимающего решение, в правильности своего выбора (какому сценарию реализации проекта следует отдать предпочтение). Значение α выбирается в интервале от 0 до 1. При $\alpha=0$ критерий Гурвица превращается в критерий крайнего оптимизма; при $\alpha=1$ – в критерий Вальда. Чем опаснее ситуации, которые могут возникнуть в ходе реализации проекта, тем больше желание «подстраховаться», тем ближе к единице выбирается этот коэффициент.

3. Методы компенсации рисков

Методы компенсации рисков относятся к упреждающим методам управления (управление по возмущению) путем стратегического планирования деятельности организации. Как средство компенсации риска стратегическое планирование дает эффект в том случае, если процесс разработки стратегии пронизывает буквально все сферы деятельности предприятия. Предотвращение рисков состоит в заблаговременном изучении каждого конкретного вида риска и принятии мер к тому, чтобы не допустить развития событий, ведущих к реализации угрозы и возникновению потерь. Особую важность имеет предотвращение рисков в процессе выдачи кредитов, и оно выражается в предварительной экспертизе документов, представленных предприятиями для получения кредитов.

К этой группе методов управления риском относятся следующие различные варианты борьбы с различными угрожающими ситуациями, связанные с созданием механизмов предупреждения опасности:

? метод «прогнозирование внешней экономической обстановки» заключается в периодической разработке сценариев развития и оценке будущего состояния среды хозяйствования для данного предприятия, в прогнозировании проведения возможных партнеров или действия конкурентов, изменений в секторах и сегментах рынка, на которых предприятие выступает продавцом или покупателем и, наконец, в региональном и общеэкономическом прогнозировании;

? метод «мониторинг социально-экономической и нормативно-правовой среды» позволяет уловить новые тенденции во взаимоотношениях хозяйствующих субъектов, заблаговременно подготовиться к нормативным новшествам, предусмотреть необходимые меры для компенсации потерь от изменения правил ведения хозяйственной деятельности, «с ходу» скорректировать тактические и стратегические планы. Существенным подспорьем здесь может стать приобретение дополнительной информации, позволяющей уточнить некоторые параметры проекта, повысить уровень надежности и достоверности исходной информации и снизить вероятность принятия неэффективного решения. Приобретение дополнительной информации целесообразно, если стоимость информации не превышает минимального среднего риска;

? метод «активный целенаправленный маркетинг» заключается в интенсивном формировании спроса на свою продукцию. Для этого используются различные маркетинговые методы и приемы: сегментация рынка, оценка его емкости; организация рекламной компании, анализ поведения конкурентов, выработка стратегии конкурентной борьбы, разработка политики и мер управления издержками;

? метод «создание системы резервов» очень близок к страхованию, но сосредоточен внутри предприятия. В этом случае на предприятии на стадии планирования создаются страховые запасы

сырья, материалов и комплектующих, резервные фонды денежных средств, формируются планы их развертывания в кризисных ситуациях, не задействуются свободные мощности, устанавливаются как бы вопреки новые контакты и связи. Этот способ предусматривает установление соотношения между потенциальными рисками, влияющими на стоимость активов проекта, и размером расходов, необходимых для преодоления нарушений в ходе его реализации.

При определении суммы резерва необходимо учитывать точность первоначальной оценки стоимости проекта и его элементов в зависимости от этапа проекта, на котором проводилась эта оценка. При первом подходе резерв делится на две части: на общий и специальный. Второй подход к созданию структуры резерва предполагает определение непредвиденных расходов по видам (статьям) затрат: основные и вспомогательные материалы, оборудование, заработная плата и т.д. В общем случае резерв не должен использоваться для компенсации потерь, понесенных вследствие неудовлетворенной работы участников проекта.

Разноуровневые задачи и задания.

Перечень вопросов (задач, заданий, тем, комплекта тестовых заданий):

Инструменты управления эффективностью компании : учебно-методическое пособие к проведению практических занятий / УГНТУ, каф. ЭНПП ; сост. С. Ф. Сайфуллина. - Уфа : УГНТУ, 2016. - 416 КБ. - URL: http://bibl.rusoil.net/base_docs/UGNTU/ENGP/Saifullina5.pdf. - Текст : электронный

Оценка и управление рисками : учебно-методическое пособие по выполнению практических работ / УГНТУ, каф. ЭНПП; сост. А. Е. Тасмуханова. - Уфа : УГНТУ, 2017. - 1,68 МБ. - Текст : электронный./ http://bibl.rusoil.net/base_docs/UGNTU/ENGP/Tasmukhanova18.pdf

Управление рисками и страхование [Электронный ресурс] : учебно-методические указания по выполнению практических заданий по дисциплине " Управление рисками и страхование" для подготовки магистров по направлению 08.02.00 – "Менеджмент" программа "Стратегический менеджмент" / УГНТУ, каф. ЭНПП ; сост. А. Е. Тасмуханова. - Уфа : УГНТУ, 2012. - 1,25 МБ.

Примеры задач

Задача 1

Владелец небольшого магазина в начале каждого дня закупает для реализации некий скоропортящийся продукт по цене 30 руб./ед. Цена реализации этого продукта – 50 руб./ед. Из наблюдений известно, что спрос на этот продукт за день может быть равен 1, 2, 3 или 4 единицы. Если продукт за день не продан, то в конце дня его всегда покупают по цене 20 руб./ед. Сколько единиц этого продукта должен закупать владелец каждый день?

С течением времени на практике стала складываться ситуация, при которой спрос 1 наблюдался 5 раз, спрос 2 наблюдался 40 раз, спрос 3 наблюдался 40 раз, спрос 4 наблюдался 15 раз, то есть стала известна частота каждого исхода.

Примите решение, пользуясь правилами: а) максимакса; б) максимина; в) минимакса; г) максимальной вероятности; д) критерием Гурвица (если показатель оптимизма равен 0,55) и максимизируя ожидаемый доход, определите, сколько единиц этого продукта должен закупать владелец каждый день? Чему равна ожидаемая стоимость полной информации?

Задача 2

Главному инженеру компании надо решить, монтировать или нет новую производственную линию, использующую новейшую технологию. Если новая линия будет работать безотказно, компания получит прибыль 200 млн. руб. Если же она откажет, компания может потерять 150 млн. рублей. По оценкам главного инженера существует 60% шансов, что новая производственная линия откажет. Можно создать экспериментальную установку, а затем уже решать, монтировать или нет производственную линию. Эксперимент обойдется в 10 млн. рублей. Главный инженер считает, что существует 50% шансов, что экспериментальная установка будет работать. Если она будет работать, то 90% шансов за то, что смонтированная производственная линия также будет работать.

Если же экспериментальная установка не будет работать, то только 20% шансов за то, что и производственная линия заработает.

Используйте дерево решений, чтобы помочь предпринимателю принять решение. Следует ли строить экспериментальную установку? Следует ли монтировать производственную линию? Какова ожидаемая стоимостная оценка наилучшего решения?

Задача 3

10 марта анализируется фьючерсный контракт на основе фондового индекса из двух акций А и В равными весами. Срок истечения фьючерсного контракта 9 июля. Делитель индекса равен 1,8. Процентная ставка составляет 11% годовых. Текущая цена акций А равна 6000 руб., текущая цена акций В равна 4000 руб. По акции А прогнозируется 12 апреля выплата дивиденда 50 руб. По акции В прогнозируется 18 мая выплата дивиденда 40 руб. Определить обоснованную величину фьючерсного контракта на основе фьючерсного индекса.

Если цена фьючерсного контракта составит 4700 руб. и возможно осуществить обратный индексный арбитраж между наличным и фьючерсными рынками, то чему будет равна возможная прибыль?

Задача 4

Текущая цена акций равна 400 руб., цена исполнения опциона составляет 403 руб. за акцию. Период исполнения равен 3 месяцам. Ставка процента 11%. Риск изменения акции составляет 14%. Определить стоимость опциона на покупку акций в данных условиях, используя формулу Блэка-Шоулза.

Задача 5

Инвестор из страны В вложил 600 тыс. денежных единиц А в государственные долгосрочные облигации страны А. Опасаясь возможного падения валюты А, он продал в сентябре при курсе А/В, равном 1,17, фьючерсы на 600 тыс. денежных единиц А с поставкой в декабре по фьючерсной цене 1,14. Определить результаты хеджирования портфеля облигаций, если в декабре цена облигаций составит 610 тыс. денежных единиц А, а курс А/В спот и фьючерсная цена будут соответственно:

- а) 1,11 и 1,08;
- б) 1,24 и 1,28.

Реферат.

Перечень вопросов (задач, заданий, тем, комплекта тестовых заданий):

Перечень вопросов (задач, заданий, тем, комплекта тестовых заданий):

Прежде чем выбрать тему реферата, автору необходимо выяснить свой интерес, определить, над какой проблемой он хотел бы поработать, более глубоко ее изучить.

Этапы работы над рефератом:

1. Формулирование темы. Тема должна быть не только актуальной по своему значению, но оригинальной, интересной по содержанию.
2. Подбор и изучение основных источников по теме (как правило, не менее 8-10).
3. Составление библиографии.
4. Обработка и систематизация информации.
5. Разработка плана реферата.
6. Написание реферата.
7. Публичное выступление с результатами исследования.

Содержание реферата включает:

- 1) обоснование выбранной темы;
- 2) использование известных результатов и фактов;

- 3) полноту цитируемой литературы, ссылки на работы ученых, занимающихся данной проблемой;
- 4) актуальность поставленной проблемы;
- 5) материал, подтверждающий научное, либо практическое значение.

Компонентами содержания реферата являются:

Титульный лист

Содержание (в нем последовательно излагаются название пунктов реферата, указываются страницы, с которых начинается каждый пункт).

Введение (формулируется суть исследуемой проблемы, обосновывается выбор темы, определяется ее значимость и актуальность, указывается цель и задачи реферата). Объем данного раздела 1-2 стр.

Основная часть (каждый раздел, доказательно раскрывая отдельную проблему или одну из её сторон, логически является продолжением предыдущего, даются все определения понятий, теоретические рассуждения, исследования автора или его изучение проблемы). Объем данного раздела 10-12 стр.

Первая глава носит теоретический характер. В ней должны быть рассмотрены имеющиеся работы отечественных и зарубежных авторов по теории и практике анализируемых в реферате проблем и возможных направлений их решения. Обычно именно это глава разбивается на три или четыре полглавы в зависимости от масштабов рассматриваемой темы.

Вторая глава, желательно, должна носить практический характер. В ней должен быть рассмотрен случай применения описываемой модели или подхода в практике предприятий.

Примерный перечень тем рефератов:

- 1) Процентные риски.
- 2) Риски активов.
- 3) Информационные риски.
- 4) Финансовые риски.
- 5) Кредитные риски
- 6) Валютные риски.
- 7) Инфляционный риск и риск ликвидности.
- 8) Риски, связанные с инвестированием в портфель ценных бумаг.
- 9) Риски, связанные с работой швейного предприятия.
- 10) Риск-менеджмент гостиниц и ресторанов.
- 11) Риски предприятий сферы сервиса.
- 12) Риск-менеджмент туризма.
- 13) Риски в деятельности предпринимательских структур
- 14) Классификационная схема видов риска в деятельности финансовых учреждений
- 15) Виды рисков в деятельности участников рынка ценных бумаг.
- 16) Риски неисполнения хозяйственных договоров.
- 17) Риски изменения рыночной конъюнктуры и усиления конкуренции.
- 18) Риски возникновения непредвиденных расходов и снижения доходов.
- 19) Риски потери имущества бизнеса.
- 20) Риск невостребованности продукции.
- 21) Организация мониторинга рисков.
- 22) Принципы информационного обеспечения системы управления риском.
- 23) Создание экзотических страховых организаций.
- 24) Превентивные и поддерживающие мероприятия риск-стратегий.
- 25) Рисковые и безрисковые активы.
- 26) Информационная система, обслуживающая процесс управления рисками

Тестирование.

Перечень вопросов (задач, заданий, тем, комплекта тестовых заданий):

Задание 1: Рискология – наука, которая призвана

Ответы: 1). Анализировать, диагностировать, прогнозировать и планировать риски 2). Устранять риски 3). Предотвращать риски 4). Снижать неопределенность 5). Планировать риски-----

Задание 2: Предпринимательский риск характеризуется

Ответы: 1). Сочетанием возможности достижения как нежелательных, так и особо благоприятных отклонений от запланированных результатов 2) Сочетанием возможности достижения нежелательных отклонений от запланированных результатов 3). Сочетанием возможности достижения благоприятных отклонений от запланированных результатов-----

Задание 3: Перечислите все функции риска

Ответы: 1). Инновационная, регулятивная, защитная, аналитическая 2). Регулятивная, защитная, инновационная 3). Финансовая, защитная, регулятивная 4). Защитная, аналитическая, финансовая, инновационная 5). Финансовая, защитная, инновационная-----

Задание 4: Управление рисками корпорации

Ответы: 1). Это процесс самооценки, который позволяет организации увидеть риски, связанные с целями ее бизнеса, и определить наилучшие способы управления своим риском 2). Это взаимосвязанные компоненты экономической системы 3). Это целенаправленное воздействие на объект управления 4). Это явление, которое появилось при переходе страны к рыночной системе хозяйствования-----

Задание 5: В основу аксиоматики риск-менеджмента положено утверждение

Ответы: 1). О неустранимости противоположностей 2). О том, что риски могут возникать только в пространстве и во времени 3) О всеобщности рисков 4). О том, что риски обладают своим внутренним пространством и временем-----

Задание 6: Категория «безрисковая зона» определяет

Ответы: 1). Условия управленческой деятельности, при которых вероятность успешного осуществления любых запланированных действий равна 100% 2). Условия, при которых вероятность выполнения запланированных мероприятий равна нулю 3). Условия выполнения запланированных мероприятий никогда не возникают 4). Условия управленческой деятельности, которые могут возникать лишь на ограниченной территории и существовать в течение конечного периода времени-----

Задание 7: Что понимается под критическим риском

Ответы: 1). Угроза потерь в размере произведенных затрат на осуществление данного вида предпринимательской деятельности или отдельной сделки 2). Угроза потерь в размере, равном или превышающем все имущественное состояние предпринимателя 3). Угроза полной потери прибыли от реализации того или иного проекта или от предпринимательской деятельности в целом-----

Задание 8: Какой классификационный признак выбран для деления предпринимательского риска на организационный, рыночный, кредитный, юридический и технико-производственный риск

Ответы: 1). В связи с производственной деятельностью 2). По аспекту возникновения 3). По фактору возникновения 4). По сфере деятельности-----

Задание 9: Основной причиной рисков, возникающих при реализации нефтегазовых проектов, является

Ответы: 1). Распределение отдачи от проекта во времени 2). Недостаток трудовых ресурсов 3). Недостаток финансовых ресурсов 4). Отсутствие правовой базы для защиты интересов инвестора-----

Задание 10: К внутренним рискам нефтегазодобывающего предприятия относится

Ответы: 1). Экологический риск 2). Природный риск 3). Маркетинговый риск 4). Политический риск-----

Задание 11: По причине возникновения геологические риски нефтегазодобывающего предприятия могут быть разделены на группы

Ответы: 1). Недостаточный объем, качество и глубина охвата исследований; ошибочная интерпретация полученных при исследованиях данных; неточность перемасштабирования 2). Неточность перемасштабирования и ошибочная интерпретация полученных при исследованиях данных 3). Ошибочная интерпретация полученных при исследованиях данных; неточность перемасштабирования; форс-мажорные обстоятельства-----

Задание 12: Технический риск характеризует:

Ответы: 1). Неточность или неполноту исходных технико-экономических показателей при планировании 2). Нехватку геологоразведочной и геофизической исследовательской информации о коллекторских свойствах пласта 3). Возможность неплатежей, банкротств, срывов договорных обязательств и иных видов невыполнения обязательств инвесторами, поставщиками и другими деловыми партнерами-----

Задание 13: Критерий Сэвиджа для оценки эффективности проектных решений в условиях неопределенности рассчитывается по формуле:

Ответы: 1). $\min \max R_{ij}$, где R_{ij} – риск от реализации i -го проекта при j -ом исходе; 2). $\max \min R_{ij}$; 3). $\max [\alpha \min R_{ij} + (1-\alpha) \max R_{ij}]$, где α – степень уверенности ЛПП; 4). $\max R_{ij}$; 5). $\min R_{ij}$

Аннотация к рабочей программе дисциплины (51818) Управление эффективностью и рисками бизнеса

Направление подготовки (специальность): 38.04.02 Менеджмент

Направленность: магистерская программа «Экономика и управление в нефтегазовом бизнесе»

Уровень высшего образования: магистратура

Форма обучения: очная;

Кафедра, обеспечивающая преподавание дисциплины: Уфимская высшая школа экономики и управления (УВШЭУ);

Компетенции, формируемые в результате освоения дисциплины

ПК-4- МЭК120-23 Способен анализировать, систематизировать и оценивать эффективность процессной архитектуры нефтегазового бизнеса, разрабатывать инновационные направления и модели оптимизации бизнес-процессов с учетом рисков составляющей в рамках развития и цифровой трансформации производства:

- ПК-4.2 Формулирует цели и оценивает реальную и потенциальную эффективность производственной деятельности, разрабатывает модели управления рисками

Результат обучения

Знать:

ПК-4--1 Знание методов разработки управленческих решений по повышению эффективности производственной деятельности нефтяных и газовых компаний с учетом фактора неопределенности

Уметь:

ПК-4--1 Умение применять различные методы учета и оценки рисков при принятии управленческих решений с целью повышения эффективности производственной деятельности нефтяных и газовых компаний

Владеть:

ПК-4--1 Навыки управления рисками, возникающими при реализации управленческих решений по повышению эффективности производственной деятельности нефтяных и газовых компаний

Краткая характеристика дисциплины

Теоретические основы управления эффективностью бизнеса. Ключевые показатели эффективности; Основы риск-менеджмента. Оценка и управление рисками бизнеса;

Трудоёмкость (з.е. / часы)

5 з.е. (180час)

Вид промежуточной аттестации

экзамен;

Разработчик(и):

_____ доцент, канд. экон. наук, Тасмуханова Альфия Ерсайиновна

СОГЛАСОВАНО

Заведующий кафедрой УВШЭУ _____ Гамилова Д. А.