

*Эта часть работы выложена в ознакомительных целях. Если вы хотите получить работу полностью, то приобретите ее воспользовавшись формой заказа на странице с готовой работой:*

<https://studservis.ru/kontrolnaya-rabota/415559>

**Тип работы:** Контрольная работа

**Предмет:** Менеджмент

Задание 1.

Задание 2.

Задание 3.

Цель: понимание специфики изучаемой рискованной ситуации.

Под идентификацией и анализом рисков следует понимать выявление рисков, их специфику, обусловленную природой и другими характерными чертами рисков, выделение особенностей их реализации, включая изучение размера экономического ущерба, а также изменение рисков во времени, степень взаимосвязи между ними и изучение факторов, влияющих на них. Без такого исследования невозможно эффективно и целенаправленно осуществлять процесс управления риском.

Этап 2. Анализ альтернативных методов управления риском

Цель: исследование тех инструментов, с помощью которых можно препятствовать реализации риска и воздействию его негативных последствий.

Основные вопросы:

Как можно снизить риск за счет подходящих превентивных мероприятий?

Как можно снизить экономический ущерб от реализации риска?

За счет каких источников можно будет покрыть такой ущерб в случае его возникновения?

Этап 3. Выбор методов управления риском

Цель: формирования политики фирмы в области борьбы с риском и неопределенностью.

Основные вопросы:

Какие методы управления риском будут наиболее эффективны при данных бюджетных и иных ограничениях?

Как изменится совокупный риск при реализации выбранной совокупности методов управления риском?

Этап 4. Исполнение выбранного метода управления риском

Содержание данного этапа заключается в исполнении принятых на предыдущем этапе решений о реализации тех или иных методов управления риском.

Основные вопросы:

Какие мероприятия необходимо реализовать?

В какие сроки это должно произойти?

Какие ресурсы и в каком объеме могут быть потрачены на осуществление данных мер?

Кто несет ответственность за исполнение принятых решений и контроль за их реализацией?

Этап 5. Мониторинг результатов и совершенствование системы управления риском

Обеспечивает обратную связь в указанной системе. Это очень важный этап, так как именно он обеспечивает гибкость и адаптивность управления риском, а также динамический характер этого процесса.

Основные вопросы:

Следует ли считать систему управления риском эффективной? Каким образом проявлялись ее узкие места?

Какие факторы повлияли на реализацию рисков за рассматриваемый период? Следует ли в связи с этим внести изменения в систему управления риском?

Все ли мероприятия, включенные в программу управления риском, сыграли свою роль в защите от неблагоприятных событий? Не следует ли заменить какие-либо меры более эффективными?

Была ли система принятия решений относительно управления риском достаточно гибкой? Не препятствовала ли она защите фирмы от риска?

На данном этапе прежде всего происходит обновление и пополнение информации о рисках, что является важным условием анализа рисков на первом этапе. Более полные свежие данные позволяют принимать адекватные и своевременные решения об управлении риском.

Задание 2.

Найти значение индекса волатильности российского рынка RVI <https://www.moex.com/ru/index/RVI> на дату выполнения задания (указать) и рассчитать величину потерь в 95% случаях за квартал от вложений в портфель, эквивалентный по структуре российскому фондовому рынку на одну тысячу рублей на стабильном рынке (в предположении о нормальном распределении доходности).

Индекс волатильности российского рынка (RVI) - индикатор срочного рынка, который рассчитывается на основе волатильности фактических цен опционов на Индекс РТС. При расчёте индекса, используются цены ближайшей и следующей за ней серий опционов со сроком до экспирации более 30 дней. Значение (23.01.2024 16:53:30) 23,75

-

*Эта часть работы выложена в ознакомительных целях. Если вы хотите получить работу полностью, то приобретите ее воспользовавшись формой заказа на странице с готовой работой:*

<https://stuservis.ru/kontrolnaya-rabota/415559>