МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ АВТОНОМНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ

«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ ТРАНСПОРТА»
(РУТ (МИИТ)

Рабочая программа дисциплины (модуля),
как компонент образовательной программы
высшего образования - программы бакалавриата
по направлению подготовки
38.03.01 Экономика,
утвержденной первым проректором РУТ (МИИТ)
Тимониным В.С.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Анализ рисков бизнеса

Направление подготовки: 38.03.01 Экономика

Направленность (профиль): Налоговый консалтинг и финансовый контроль

Форма обучения: Очная

Рабочая программа дисциплины (модуля) в виде электронного документа выгружена из единой корпоративной информационной системы управления университетом и соответствует оригиналу

Простая электронная подпись, выданная РУТ (МИИТ)
ID подписи: 10017
Подписал: заведующий кафедрой Макеева Елена Захаровна
Дата: 01.06.2021

1. Общие сведения о дисциплине (модуле).

Цель изучения дисциплины - формирование у студентов теоретических знаний и практических навыков по оценке рисков и применения полученных при этом знаний в своей практической деятельности.

Задачей изучения дисциплины является: приобретение знаний по анализу и прогнозированию систем управления рисками хозяйствующих субъектов, умений сбора и использования необходимой информации, навыков принятия управленческих решений с учетом специфики объекта, целей и направления использования результатов анализа и прогнозирования рисков, а также состояния деятельности хозяйствующего субъекта.

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю).

Перечень формируемых результатов освоения образовательной программы (компетенций) в результате обучения по дисциплине (модулю):

ПК-1 - Способен формировать налоговые базы по всем налогам, входящим в налоговую систему РФ.

Обучение по дисциплине (модулю) предполагает, что по его результатам обучающийся будет:

Знать:

-основные виды, типы и факторы экономического риска и их классификации в зависимости от задач и уровня исследования, сферы бизнеса;

-механизм управления риском;

-методологию оценки экономических рисков; способы и средства снижения экономического риска;

-методы оценки целесообразности их использования.

Уметь:

- работать с информацией в глобальных компьютерных сетях;

- обосновать систему показателей с учетом содержания изучаемых рисков;

- систематизировать массивы полученных данных;

использовать различные источники экономической, социальной и управленческой -работать с информацией в глобальных компьютерных сетях;

-обосновать систему показателей с учетом содержания изучаемых рисков;

-систематизировать массивы полученных данных;

использовать различные источники экономической, социальной и

управленческой

информации;

-выявлять проблемы экономического характера при анализе конкретных ситуации, предлагать способы их решения с учетом критериев социально-экономической эффективности, оценки рисков и возможных социально-экономических последствий

-экономически обоснованно использовать методы снижения рисков для управления предприятиями и организациями, для регулирования и прогнозирования экономических и финансовых явлений и процессов краткосрочном и долгосрочном периодах;

-осуществлять выбор инструментальных средств для обработки данных в соответствии с поставленной задачей, анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные выводы;

-прогнозировать поведение экономических агентов в условиях риска.

Владеть:

-методологией исследования рисков;

-современными методиками расчета и анализа социально-экономических показателей, финансовых явлении? и процессов в условиях неопределенности;

-методами комплексной оценки деятельности предприятия (организации) и его внешней среды с учетом риска;

-навыками осуществления экспертной оценки факторов риска;

-навыками разработки и реализации оптимальных управленческих решении? по минимизации риска с учетом критериев социально-экономической эффективности;

-навыками самостоятельной работы, самоорганизации и организации выполнения задании? по оценке и управлению рисками.

3. Объем дисциплины (модуля).

3.1. Общая трудоемкость дисциплины (модуля).

Общая трудоемкость дисциплины (модуля) составляет 5 з.е. (180 академических часа(ов).

3.2. Объем дисциплины (модуля) в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении учебных занятий:

Тип учебных занятий	Количество

	часов	
	Всего	Сем. №8
Контактная работа при проведении учебных занятий (всего):	72	72
В том числе:		
Занятия лекционного типа	40	40
Занятия семинарского типа	32	32

3.3. Объем дисциплины (модуля) в форме самостоятельной работы обучающихся, а также в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении промежуточной аттестации составляет 108 академических часа (ов).

3.4. При обучении по индивидуальному учебному плану, в том числе при ускоренном обучении, объем дисциплины (модуля) может быть реализован полностью в форме самостоятельной работы обучающихся, а также в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении промежуточной аттестации.

4. Содержание дисциплины (модуля).

4.1. Занятия лекционного типа.

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
1	«Сущность и предпосылки экономического риска в рыночной экономике» Рассматриваемые вопросы: - Природа неизбежности экономического риска; взаимосвязь понятии? "риск" и "неопределенность". - Объективные и субъективные причины экономического риска в рыночной экономике.
2	«Сущность и предпосылки экономического риска в рыночной экономике» Рассматриваемые вопросы: - Понятие риска. - Сущность неоклассической предпринимательского признаки рисковой ситуации.
3	«Сущность и предпосылки экономического риска в рыночной экономике» Рассматриваемые вопросы: - Функции предпринимательского риска. - Цель и задачи исследования экономического риска. - Механизм исследования экономического риска: этапы, их содержание и взаимосвязь.

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
4	«Виды и факторы экономического риска» Рассматриваемые вопросы: - Понятие предпринимательского и потребительского риска. - Многообразие предпринимательских рисков и проблемы их классификации.
5	«Виды и факторы экономического риска» Рассматриваемые вопросы: - Общая и целевые классификация предпринимательских рисков. - Основные классификации рисков предприятия.
6	«Виды и факторы экономического риска» Рассматриваемые вопросы: - Сущность и факторы риска в различных сферах экономики. - Основные факторы экономического риска в современной российской экономике.
7	«Методология оценки рисков» Рассматриваемые вопросы: - Основные критерии оценки экономического риска и методологические принципы их измерения. - Виды и методические особенности оценки потерь, связанных с экономическим риском. - Сущность и параметры основных зон экономического риска.
8	«Методология оценки рисков» Рассматриваемые вопросы: - Качественная и количественная оценка риска. - Методические особенности анализа риска конкретных факторов риска и видов бизнеса.
9	«Механизм управления риском, способы и средства снижения экономического риска» Рассматриваемые вопросы: - Понятие «риск-менеджмент». - Функции, организация и стратегия риск-менеджмента.
10	«Механизм управления риском, способы и средства снижения экономического риска» Рассматриваемые вопросы: - Основные правила и критерии риск- менеджмента. - Этапы процесса управления риском. - Комплексный подход к управлению риском.
11	«Механизм управления риском, способы и средства снижения экономического риска» Рассматриваемые вопросы: - Механизм нейтрализации экономического риска и основные его принципы. - Средства разрешения экономического риска (избежание, передача, сохранение): сущность, способы реализации и взаимосвязь.
12	«Отношение к экономическому риску» Рассматриваемые вопросы:

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
	- Классификация индивидов с позиции отношения к риску. -Гипотеза рационального экономического поведения предпринимателей в условиях риска и ее связь с теорией полезности. - Кривая полезности и объяснение смысла ее сегментов с точки зрения типов экономического поведения индивидов в условиях риска с позиции предпочтительности выбора вида экономической деятельности.

4.2. Занятия семинарского типа.

Практические занятия

№ п/п	Тематика практических занятий/краткое содержание
1	«Сущность и предпосылки экономического риска в рыночной экономике» На практических занятиях студент узнает Природу неизбежности экономического риска.
2	«Сущность и предпосылки экономического риска в рыночной экономике» На практических занатиях студент узучает сущность неоклассической предпринимательского признаки рисковой ситуации
3	«Сущность и предпосылки экономического риска в рыночной экономике» На практических занатиях студент узучает функции предпринимательского риска, механизм исследования экономического риска.
4	«Виды и факторы экономического риска» На практических занатиях студент изучает понятие предпринимательского и потребительского риска, узнает основные классификации рисков предприятия.
5	«Виды и факторы экономического риска» На практических занатиях студент изучает сущность и факторы риска в различных сферах экономики
6	«Методология оценки рисков» На практических занатиях студент изучает основные критерии оценки экономического риска и методологические принципы их измерения
7	«Методология оценки рисков» На практических занатиях студент изучает виды и методические особенности оценки потерь, связанных с экономическим риском
8	«Методология оценки рисков» На практических занатиях студент изучает методические особенности анализа риска конкретных факторов риска и видов бизнеса
9	«Механизм управления риском, способы и средства снижения экономического риска» На практических занатиях студент изучает средства разрешения экономического риска (избежание, передача, сохранение): сущность, способы реализации и взаимосвязь
10	«Механизм управления риском, способы и средства снижения экономического риска»

№ п/п	Тематика практических занятий/краткое содержание
	На практических занатиях студент изучает эЭтапы процесса управления риском и комплексный подход к управлению риском.
11	«Отношение к экономическому риску» На практических занатиях студент изучает гипотезу рационального экономического поведения предпринимателей в условиях риска и ее связь с теорией полезности.
12	«Отношение к экономическому риску» На практических занатиях студент изучает кривую полезности и смысл ее сегментов с точки зрения типов экономического поведения индивидов в условиях риска с позиции предпочтительности выбора вида экономической деятельности.

4.3. Самостоятельная работа обучающихся.

№ п/п	Вид самостоятельной работы
1	Подготовка к практическим занятиям
2	Работа с лекционным материалом
3	Работа с литературой
4	Изучение дополнительных тем
5	Выполнение курсовой работы.
6	Подготовка к промежуточной аттестации.
7	Подготовка к текущему контролю.

4.4. Примерный перечень тем курсовых работ

1. Общие представления об экономических рисках
2. Методы оценки экономических рисков
3. Специальные методы оценки рисков:
4. Способы моделирования рисковых ситуации?
5. Моделирование инвестиционных рисков
6. Хеджирование рисков
7. Моделирование рисков инвестиционных проектов
8. Моделирование рисков корпорации?
9. Переход от моделирования отдельных процессов к интегрированной системе управления рисками
10. Особенности моделирования риск-содержащих событии? с помощью метода Монте-Карло

11. Структурно-динамический анализ (на конкретном примере).

12. Коэффициентный анализ (на конкретном примере).

13. Ретроспективный анализ оценки стоимости капитала.

14. Сравнительный анализ моделей Альтмана (на конкретном примере).

15. Использование готовых информационных продуктов для прогнозирования банкротства предприятия (на конкретном примере).

16. Расчет эффективности инвестиционного проекта (на конкретном примере).

17. Факторинг или скидка (на конкретном примере)?

18. Улучшение финансового состояния предприятия (на конкретном примере).

19. Отличия хеджирования от страхования.

20. Анализ кредитоспособности субъекта по методике АКБ (на конкретном примере).

5. Перечень изданий, которые рекомендуется использовать при освоении дисциплины (модуля).

№ п/п	Библиографическое описание	Место доступа
1	Управление рисками : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 485 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12206-0.	https://urait.ru/bcode/469401 (дата обращения: 19.03.2024).— Текст : электронный
2	Анализ и оценка рисков в бизнесе : учебник и практикум для вузов / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 381 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00375-8.	https://urait.ru/bcode/468977 (дата обращения: 19.03.2024).— Текст : электронный
3	Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 365 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-3502-8.	https://urait.ru/bcode/469020 (дата обращения: 19.03.2024).— Текст : электронный

6. Перечень современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем, которые могут использоваться при освоении дисциплины (модуля).

КонсультантПлюс http://www.consultant.ru/

Гарант http://www.garant.ru/

7. Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства, необходимого для освоения дисциплины (модуля).

Офисный пакет приложений Microsoft Office

8. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю).

Для проведения лекционных занятий необходима аудитория с мультимедиа аппаратурой.

9. Форма промежуточной аттестации:

Курсовая работа в 8 семестре.
Экзамен в 8 семестре.

10. Оценочные материалы.

Оценочные материалы, применяемые при проведении промежуточной аттестации, разрабатываются в соответствии с локальным нормативным актом РУТ (МИИТ).

Авторы:

доцент, к.н. кафедры
«Международный финансовый и
управленческий учет» М.А. Калачев

Согласовано:

Заведующий кафедрой МФиУУ Е.З. Макеева

Председатель учебно-методической
комиссии М.В. Ишханян