

**МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ  
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ АВТОНОМНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ  
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ ТРАНСПОРТА»**

Кафедра        «Финансы и кредит»

**АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ**

**«Риск-менеджмент в системе экономической безопасности организации»**

Специальность:	<u>38.05.01 – Экономическая безопасность</u>
Специализация:	<u>Финансово-экономическое обеспечение федеральных государственных органов, обеспечивающих безопасность Российской Федерации</u>
Квалификация выпускника:	<u>Экономист</u>
Форма обучения:	<u>очная</u>
Год начала подготовки	<u>2020</u>

## 1. Цели освоения учебной дисциплины

- изучение теоретических и методических основ оценки рисков в деятельности хозяйствующих субъектов;
- обеспечение подготовки студентов на уровне требований к профессиональной деятельности в современных условиях.

## 2. Место учебной дисциплины в структуре ОП ВО

Учебная дисциплина "Риск-менеджмент в системе экономической безопасности организации" относится к блоку 1 "Дисциплины (модули)" и входит в его вариативную часть.

## 3. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю), соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

ПКС-1	способен проводить комплексный анализ функционирования финансовых и экономических структур государственного, отраслевого и корпоративного уровня с целью выявления угроз экономической безопасности Российской Федерации (отрасли, предприятия)
-------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 4. Общая трудоемкость дисциплины составляет

4 зачетные единицы (144 ак. ч.).

## 5. Образовательные технологии

Основными формами проведения занятий являются лекции и практические занятия. На данных занятиях важно сформировать интерес студентов к теоретическим аспектам и основным направлениям практической работы в области анализа рисков. При проведении лекционных занятий следует учитывать многосторонний характер изучаемых аспектов управления рисками, поэтому необходимо применять разные формы лекций: информационно-объяснительные, проблемные, лекции-дискуссии, лекции-беседы и т.п. В целях повышения качества освоения студентами изучаемой дисциплины, целесообразно использовать инновационные методы обучения. Кроме того, в ходе проведения лекций и практических занятий особое внимание уделяется практической ориентации материала. Для максимального усвоения дисциплины рекомендуется проведение письменного опроса (тестирование) студентов по материалам лекций и практических занятий. Подборка вопросов для тестирования осуществляется на основе изученного теоретического материала. Основными формами контроля являются: текущий контроль в виде тестирования по всем разделам учебной дисциплины, проверки правильности выполнения практических заданий и промежуточный контроль в виде экзамена.

## 6. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам)

### РАЗДЕЛ 1

Место и роль экономических рисков в управлении деятельностью организаций  
Раздел 1.

Место и роль экономических рисков в управлении деятельностью организаций  
Система неопределенностей и принципы классификации экономических рисков  
ПЗ№1. Построение системы классификации экономических рисков хозяйствующего субъекта

Функции экономических рисков. Внешние и внутренние факторы окружающей среды.

ПЗ№2. Анализ внешних факторов бизнес-окружения хозяйствующего субъекта  
ПЗ№3. Анализ внутренних факторов бизнес-окружения хозяйствующего субъекта

## РАЗДЕЛ 2

Теоретические основы анализа рисков

Сущность и основные задачи риск-менеджмента. Процесс управления риском.

Математические методы оценки экономических рисков.

ПЗ№4. Оценка риска на основе анализа финансовых показателей деятельности предприятия.

ПЗ№5-6. Разработка рекомендаций по формированию системы управления рисками (СУР)

## РАЗДЕЛ 3

Количественные оценки экономического риска в условиях неопределенности

Методы принятия эффективных решений в условиях неопределенности. Матричные игры: понятие игры с природой, предмет и основные понятия теории игр

ПЗ№7. Текущий контроль знаний по разделам 1 и 2. Разбор наиболее частых ошибок.

Критерии эффективности в условиях полной неопределенности: критерий гарантированного результата, критерий оптимизма, критерий пессимизма, критерий Сэвиджа, критерий Гурвица. ПЗ№8. Обсуждение докладов и рефератов

ПЗ№9-10. Применение теории игр для определения оптимального поведения игрока на рынке

## РАЗДЕЛ 3

Количественные оценки экономического риска в условиях неопределенности  
устный опрос, защита докладов

## РАЗДЕЛ 4

Принятие оптимального решения в условиях экономического кризиса

Статистические методы принятия решений с условиями риска. Выбор оптимального плана методом построения деревьев событий: «дерево решений», оптимизация стратегии выхода на рынок.

ПЗ№11. Оценка вероятности ожидаемого ущерба в результате наступления рискованной ситуации, построение «дерева решений».

## РАЗДЕЛ 5

Основные методы воздействия на экономические риски  
устный опрос, защита докладов

## РАЗДЕЛ 5

Основные методы воздействия на экономические риски

Общие принципы управления риском: схема процессов управления риском, примеры рисков, приемы управления риском

ПЗ№12. Выбор и применение приемов управления риском

Диверсификация. Страхование риска: сущность страхования, основные характеристики страховых контрактов, расчет страховых операций, страховой контракт, преимущества и недостатки страхования

ПЗ№13. Текущий контроль знаний по разделам 3 и 4. Разбор наиболее частых ошибок.

ПЗ№14. Обсуждение докладов и рефератов (в форме семинара)

ПЗ№15. Хеджирование: стратегии управления риском, основные понятия, форвардные и фьючерсные контракты.

ПЗ№16. Хеджирование: хеджирование валютного курса, основные аспекты риска, хеджирование валютного курса с помощью свопа, опционы

ПЗ№17. Лимитирование. Самострахование. Качественное управление рисками.  
Приобретение дополнительной информации

ПЗ№18. Оценка эффективности методов управления рисками

РАЗДЕЛ 6

Диф. зачет