

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)

Риск-менеджмент

Направление подготовки: 38.03.01 Экономика

Направленность (профиль): Финансы и кредит

Форма обучения: Заочная

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: 4329
Подписал: заведующий кафедрой Шкурина Лидия
Владимировна
Дата: 28.04.2025

1. Общие сведения о дисциплине (модуле).

Целью освоения учебной дисциплины «Риск-менеджмент» является формирование у обучающихся компетенций в соответствии с требованиями самостоятельно утвержденного образовательного стандарта высшего образования (СУОС) по направлению подготовки 38.03.01 "Экономика", а также формирование у студентов современных фундаментальных знаний в области управления финансовыми рисками экономических субъектов.

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю).

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

ПК-61 - Способен осуществлять сбор, мониторинг и обработку данных для проведения расчетов экономических показателей организации;

ПК-62 - Способен проводить расчет экономических показателей результатов деятельности организации;

ПК-65 - Способен управлять рисками по отдельным функциональным направлениям.

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

Знать:

знает методы управления рисками при осуществлении инвестиционной и инновационной деятельности

Уметь:

Способен разрабатывать инвестиционные проекты и программы развития с учетом риск-ориентированного подхода

Владеть:

навыки разработки мероприятий, направленных на повышение финансового результата

3. Объем дисциплины (модуля).

3.1. Общая трудоемкость дисциплины (модуля).

Общая трудоемкость дисциплины (модуля) составляет 6 з.е. (216 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	Семестр №5
Контактная работа при проведении учебных занятий (всего):	24	24
В том числе:		
Занятия лекционного типа	12	12
Занятия семинарского типа	12	12

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 192 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	Раздел 1 Понятие и сущность финансовых рисков как объекта риск-менеджмента. Риск как экономическая категория. Особенности риска. Различные определения финансового риска. Сущность финансового риска. Объективная и субъективная основа финансового риска. Финансовые риски в внутри финансовой деятельности фирмы. Финансовые риски и внешняя финансовая среда деятельности фирмы. Классификация видов финансовых рисков. Раздел 2 Методология риск-менеджмента. Методологические основы управления рисками в экономике. Риск-менеджмент. Стратегия. Тактика. Объект управления. Субъект управления. Функции. Схема управления рисками. Основные этапы процесса управления риском. Концепции управления рисками. Структура службы риск-менеджмента.

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
	Раздел 3 Оценка финансовых рисков. Классификация методов оценки и анализа финансовых рисков. Количественные методы оценки и анализа финансовых рисков: методы математической статистики: метод математического ожидания, метод стандартного отклонения, метод коэффициента вариации, методы корреляционно-регрессионного анализа, метод анализа безубыточности, метод анализа чувствительности, метод анализа сценариев, методы многофакторного анализа. Качественные методы оценки и анализа финансовых рисков: экспертные методы оценки, метод рейтинговых оценок, метод «Due Diligence», метод «дерево решений», метод построения «дерева событий». Комбинированные качественно-количественные методы оценки и анализа финансовых рисков: методы имитационного моделирования, метод Дельфи, метод «Монте-Карло». Раздел 4 Методы управления финансовыми рисками. Методы трансформации рисков. Отказ от риска. Снижение вероятности ущерба или предотвращение убытка. Уменьшение размера убытков. Разделение риска (дифференциация и дублирование). Аутсорсинг риска. Методы финансирования рисков. Раздел 5 Хеджирование финансовых рисков с использованием производных финансовых инструментов. Классификация производных финансовых инструментов как методов управления финансовыми рисками: опционы, форварды, фьючерсы, свопы и другие финансово – кредитные деривативы. Сущность и виды хеджирования. Основные виды стратегий хеджирования и биржевая спекуляция.

4.2. Занятия семинарского типа.

Практические занятия

№ п/п	Тематика практических занятий/краткое содержание
1	Раздел 2 Методология риск-менеджмента. Построение карты рисков Раздел 3 Оценка финансовых рисков. Оценка финансовых рисков компании. Проведение деловой игры на тему "Оценка финансовых рисков компании"

4.3. Самостоятельная работа обучающихся.

№ п/п	Вид самостоятельной работы
1	Раздел 1 Понятие и сущность финансовых рисков как объекта риск-менеджмента - самостоятельное изучение и конспектирование отдельных тем учебной литературы, связанных с разделом; подготовка к текущему и промежуточному контролю [1-5] Раздел 2. Методология риск-менеджмента - самостоятельное изучение и конспектирование отдельных

№ п/п	Вид самостоятельной работы
	тем учебной литературы, связанных с разделом; подготовка к текущему и промежуточному контролю [1-5] Раздел 3 Оценка финансовых рисков - самостоятельное изучение и конспектирование отдельных тем учебной литературы, связанных с разделом; подготовка к текущему и промежуточному контролю [1-5] Раздел 4 Методы управления финансовыми рисками - самостоятельное изучение и конспектирование отдельных тем учебной литературы, связанных с разделом; подготовка к текущему и промежуточному контролю [1-5] Раздел 5 Хеджирование финансовых рисков с использованием производных финансовых инструментов - самостоятельное изучение и конспектирование отдельных тем учебной литературы, связанных с разделом; подготовка к текущему и промежуточному контролю [1-5]
2	Подготовка к промежуточной аттестации.

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

№ п/п	Библиографическое описание	Место доступа
1	Анализ и оценка рисков в бизнесе Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова Книга М. : Юрайт, 2016. Электронно-библиотечная система "ЮРАЙТ"	
2	Основы риск-менеджмента М. Круи, Д. Галай, Р. Марк ; науч. ред. В. Б. Минасян. Книга М. : Юрайт, 2016. Электронно-библиотечная система "ЮРАЙТ"	
1	Финансовые риски М. Л. Кричевский Книга Электронные текстовые данные. - М. : КноРус, 2013. Электронно-библиотечная система book.ru	
2	Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски (для бакалавров) Грибов В.Д. Книга 2015, КноРус, электронно-библиотечная система book.ru	
3	Журнал "Экономика железных дорог" руководители и ведущие эксперты железнодорожной отрасли; Гандельсман Татьяна Александровна - главный редактор Сидоров Александр Борисович - ответственный редактор Книга с 1999г.; библиотека РОАТ	

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

Информационно-правовой портал Гарант <http://www.garant.ru/>
Официальный сайт Банка России <http://www.cbr.ru/> Электронно-библиотечная система ibooks.ru <http://ibooks.ru/> Электронно-библиотечная система ibooks.ru <http://ibooks.ru/>

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

Текстовый редактор Microsoft Office Word Вычислительный редактор Microsoft Office Excel Графический редактор Microsoft Power Point

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

МТО Учебная аудитория должна соответствовать требованиям пожарной безопасности и охраны труда по освещенности, количеству рабочих (посадочных) мест студентов. Для проведения аудиторных лекционных и практических занятий требуется рабочее место преподавателя со стулом, столом, доской, мелом или маркером. Для проведения информационно-коммуникационных (интерактивных занятий - представления презентаций) требуется мультимедийное оборудование (проектор), компьютер.

9. Форма промежуточной аттестации:

Экзамен в 5 семестре.

10. Оценочные материалы.

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

Авторы:

старший преподаватель кафедры
«Экономика, финансы и управление
на транспорте»

Е.Н. Сертакова

Согласовано:

Заведующий кафедрой ЭИФ РОАТ
Председатель учебно-методической
комиссии

Л.В. Шкурина

С.Н. Климов