

**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 магистратуры  
по направлению подготовки  
38.04.01 Экономика,  
утвержденной первым проректором РУТ (МИИТ)  
Тимониным В.С.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

**Система управления финансовыми рисками**

Направление подготовки: 38.04.01 Экономика

Направленность (профиль): Экономика и финансы транспортного бизнеса

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: 2699  
Подписал: заведующий кафедрой Межох Зоя Павловна  
Дата: 14.04.2023

## 1. Общие сведения о дисциплине (модуле).

Цель изучения дисциплины – формирование у обучающихся теоретических и практических знаний, умений и навыков принятия управленческих решений в условиях риска в целях повышения эффективности использования финансовых ресурсов в сфере транспортного бизнеса.

Задачами освоения дисциплины являются :

- изучение ключевых предпосылов возникновения рисков и основы теории управления ими;
- освоение приемов и методов оценки рисков с учетом специфики деятельности транспортного бизнеса;
- выработка навыков использования современных инструментариев управления финансовыми рисками с целью повышения эффективности использования финансовых ресурсов.

## 2. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю).

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

**ПК-1** - Способен осуществлять планирование и реализацию мероприятий по совершенствованию финансово-экономической деятельности в транспортном бизнесе, выявлять проблемы в экономике и финансах транспортного бизнеса с применением современного управленческого инструментария;

**ПК-4** - Способен понимать сущность экономических процессов транспортной отрасли в современных условиях, определять направления развития транспортного бизнеса и выполнять расчёты показателей, характеризующих производственно-экономическую деятельность транспортных компаний.

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

### **Знать:**

- основные приемы и методы выявления проблем в экономике и финансах транспортного бизнеса;
- сущность экономических процессов транспортной отрасли в современных условиях.

### **Уметь:**

- выявлять проблемы в экономике и финансах транспортного бизнеса, а

также осуществлять планирование мероприятий по совершенствованию финансово-экономической деятельности;

- определять приоритетные направления развития транспортного бизнеса.

**Владеть:**

- современным управленческим инструментарием выявления рисков в экономике и финансах транспортного бизнеса;

- способами расчета показателей, характеризующих производственно-экономическую деятельность транспортных компаний.

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	Семестр №3
Контактная работа при проведении учебных занятий (всего):	32	32
В том числе:		
Занятия лекционного типа	16	16
Занятия семинарского типа	16	16

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 148 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	Финансовые риски в системе управления организации. Рассматриваемые вопросы: - Характеристика основных элементов системы управления рисками; - Алгоритм управления рисками; - Процесс управления рисками.
2	Классификация финансовых рисков. Рассматриваемые вопросы: - Виды финансовых рисков; - Группы рисков по характеру финансовых последствий; - Финансовые риски по возможности их прогнозирования.
3	Методы управления финансовыми рисками. Рассматриваемые вопросы: - Сущность и содержание управления финансовыми рисками; - Этапы управления финансовыми рисками; - Методы управления финансовыми рисками.
4	Количественные и качественные методы анализа финансовых рисков. Рассматриваемые вопросы: - Методы идентификации финансовых рисков; - Качественный и количественный анализ рисков; - Использование инструментария теории вероятности и математической статистики.
5	Количественные и качественные методы анализа финансовых рисков. Рассматриваемые вопросы: - Методы оценки финансовых рисков: статистический, аналитические, экспертных оценок; - Расчет стоимости финансирования рисков.
6	Способы минимизации рисков. Рассматриваемые вопросы: - Стратегии управления финансовыми рисками: избежание, принятие и передача риска; - Методы уклонения от риска и их последствия.
7	Способы минимизации рисков. Рассматриваемые вопросы: - Методы локализации, диссипации и компенсации риска; - Производные риски и их использование.
8	Оценка эффективности управления финансовыми рисками. Рассматриваемые вопросы: - Критерии оценки эффективности; - Факторы, влияющие на эффективность управления финансовым риском; - Относительная оценка эффективности управления риском на основе анализа финансового состояния организации.

##### 4.2. Занятия семинарского типа.

##### Практические занятия

№ п/п	Тематика практических занятий/краткое содержание
1	<b>Финансовые риски в системе управления организации.</b> В результате работы на практическом занятии студент подробно знакомится с алгоритмом и процессом управления рисками.
2	<b>Классификация финансовых рисков.</b> В результате работы на практическом занятии студент приобретает навыки классификации рисков в зависимости от возможностей их прогнозирования и характера финансовых последствий.
3	<b>Методы управления финансовыми рисками.</b> В результате работы на практическом занятии студент знакомится на практике с различными методами управления финансовыми рисками.
4	<b>Качественные методы анализа финансовых рисков.</b> В результате работы на практическом занятии студент изучает методы идентификации финансовых рисков и приобретает навыки практического использования инструментария теории вероятности и математической статистики.
5	<b>Количественные методы анализа финансовых рисков.</b> В результате работы на практическом занятии студент и приобретает навыки практического использования методов количественной оценки финансовых расчетов и калькуляции стоимости их финансирования.
6	<b>Способы минимизации рисков.</b> В результате работы на практическом занятии студент рассматривает на примерах различные стратегии управления рисками а также изучает возможности практического применения метода уклонения от риска.
7	<b>Способы минимизации рисков.</b> В результате работы на практическом занятии студент осваивает практическое применение методов локализации, диссипации и компенсации риска, а также производных рисков.
8	<b>Оценка эффективности управления финансовыми рисками.</b> В результате работы на практическом занятии студент учится формировать критерии оценки эффективности а так же на примере выбранной организации производит оценку эффективности управления риском на основе анализа финансового состояния.

#### 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	Подготовка к промежуточной аттестации.
5	Подготовка к текущему контролю.

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

№ п/п	Библиографическое описание	Место доступа
1	Управление финансовыми рисками в системе	<a href="https://urait.ru/bcode/510935">https://urait.ru/bcode/510935</a>

	экономической безопасности : учебник и практикум для вузов / Н. А. Пименов. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 326 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-04539-0.3.	(дата обращения: 27.02.2023). - Текст: электронный.
2	Управление финансовыми рисками : учебник и практикум для вузов / И. П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И. П. Хоминич. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 569 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-13380-6.	<a href="https://urait.ru/bcode/511958">https://urait.ru/bcode/511958</a> (дата обращения: 27.02.2023). - Текст: электронный.

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

Научно-техническая библиотека РУТ (МИИТ): <http://library.miiit.ru>

Федеральная служба государственной статистики: <https://rosstat.gov.ru/>

Электронная библиотечная система «Юрайт»: <https://www.urait.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. Для проведения практических занятий требуется аудитория, оснащенная мультимедиа аппаратурой и ПК с необходимым программным обеспечением и подключением к сети интернет.

9. Форма промежуточной аттестации:

Зачет в 3 семестре.

10. Оценочные материалы.

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

Авторы:

доцент, доцент, к.н. кафедры  
«Финансы и кредит»

И.П. Акимова

Согласовано:

и.о. заведующего кафедрой ЭУТ

М.Г. Данилина

Заведующий кафедрой ФК

З.П. Межох

Председатель учебно-методической  
комиссии

М.В. Ишханян