

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

УТВЕРЖДАЮ:

Директор ИЭФ



Ю.И. Соколов

26 июня 2019 г.



Кафедра «Финансы и кредит»

Автор Комкова Ирина Николаевна, к.э.н., доцент

АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ

«Теория и методология анализа рисков»

Направление подготовки:	38.03.01 – Экономика
Профиль:	Экономическая безопасность, анализ и управление рисками
Квалификация выпускника:	Бакалавр
Форма обучения:	очная
Год начала подготовки	2019

<p style="text-align: center;">Одобрено на заседании Учебно-методической комиссии института Протокол № 8 25 июня 2019 г. Председатель учебно-методической комиссии</p>  <p style="text-align: right;">М.В. Ишханян</p>	<p style="text-align: center;">Одобрено на заседании кафедры</p> <p>Протокол № 16 24 июня 2019 г. Заведующий кафедрой</p>  <p style="text-align: right;">З.П. Межох</p>
---	---

Москва 2019 г.

1. Цели освоения учебной дисциплины

Целью освоения учебной дисциплины «Теория и методология анализа рисков» является формирование у студентов системного представления о современных методах оценки рисков в деятельности хозяйствующих субъектов, а также на развитие практических навыков в области анализа и прогнозирования рисков.

2. Место учебной дисциплины в структуре ОП ВО

Учебная дисциплина "Теория и методология анализа рисков" 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-7	способен классифицировать и оценивать риски внешней и внутренней среды функционирования хозяйствующих субъектов, выявлять причины и условия, способствующие проявлению негативных факторов, оказывающих деструктивное влияние на экономическую безопасность хозяйствующих субъектов
-------	---

4. Общая трудоемкость дисциплины составляет

4 зачетные единицы (144 ак. ч.).

5. Образовательные технологии

Преподавание дисциплины осуществляется в форме лекционных и практических занятий. Лекции проводятся в традиционной классно-урочной организационной форме, по типу управления познавательной деятельности являются классическо-лекционными (объяснительно-иллюстративными). Практические занятия организованы с использованием технологий развивающего обучения. Практический курс выполняется в виде традиционных практических занятий (объяснительно-иллюстративное решение задач), с использованием интерактивных (диалоговые) технологий, в том числе разбор и анализ конкретных ситуаций, электронный практикум (компьютерное моделирование и практический анализ результатов); технологий, основанных на коллективных способах обучения, а также с использованием компьютерной тестирующей системы. Самостоятельная работа студента организована с использованием традиционных видов работы и интерактивных технологий. К традиционным видам работы относятся отработка учебного материала и отработка отдельных тем по учебным пособиям, подготовка к промежуточным контролям, выполнение заданий курсовой работы. К интерактивным (диалоговым) технологиям относятся отработка отдельных тем по электронным пособиям, подготовка к промежуточным контролям в интерактивном режиме, интерактивные консультации в режиме реального времени по специальным разделам и технологиям, основанным на коллективных способах самостоятельной работы студентов. Оценка полученных знаний, умений и навыков основана на модульно-рейтинговой технологии. Весь курс разбит на разделы, представляющих собой логически завершённый объём учебной информации. Фонды оценочных средств освоенных компетенций включают как вопросы теоретического характера для оценки знаний, так и задания практического содержания (решение практических и ситуационных задач, выполнение заданий курсовой работы) для оценки умений и навыков. Теоретические знания проверяются путём применения таких организационных форм, как

индивидуальные и групповые опросы, решение тестов с использованием компьютеров или на бумажных носителях. .

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

РАЗДЕЛ 1

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

Тема: Понятие и сущность экономических рисков.

Система неопределенностей и принципы классификации экономических рисков.

ПЗ№1. Построение системы классификации экономических рисков хозяйствующего субъекта

Тема: ПЗ№3. Анализ внутренних факторов бизнес-окружения хозяйствующего субъекта

Тема: Функции экономических рисков. Внешние и внутренние факторы окружающей среды.

РАЗДЕЛ 3

Раздел 2. Теоретические основы анализа рисков

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

Тема: Математические методы оценки экономических рисков.

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

РАЗДЕЛ 4

Раздел 3. Количественные оценки экономического риска в условиях неопределенности

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

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

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

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

РАЗДЕЛ 5

Раздел 4. Принятие оптимального решения в условиях экономического кризиса

Тема: 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 6

Раздел 5. Основные методы воздействия на экономические риски

Тема: Общие принципы управления риском: схема процессов управления риском,

примеры рисков, приемы управления риском

Тема: ПЗ№12. Выбор и применение приемов управления риском

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

Тема: Хеджирование: стратегии управления риском, основные понятия, форвардные и фьючерсные контракты

Тема: Хеджирование: хеджирование валютного курса, основные аспекты риска, хеджирование валютного курса с помощью свопа, опционы

Тема: Хеджирование: страхование или хеджирование, синхронизация потоков денежных средств, модель хеджирования, измерение эффективности хеджирования, минимизация расходов на хеджирование

Тема: Лимитирование. Самострахование. Качественное управление рисками. Приобретение дополнительной информации

Экзамен