

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)

Теория и методология анализа рисков

Направление подготовки: 38.03.01 Экономика

Направленность (профиль): Экономическая безопасность, анализ и
управление рисками

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: 01.05.2021

1. Общие сведения о дисциплине (модуле).

Целями освоения дисциплины 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.

Задачами освоения дисциплины является формирование у обучающихся знаний основных методов анализа экономических рисков, умений анализировать информационные и статистические материалы по оценке влияния на хозяйственные результаты деятельности предприятия экономических рисков, используя современные методы и показатели такой оценки, навыков оценки и прогнозирования экономических рисков.

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю).

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

ПК-1 - 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;

ПК-2 - Способен готовить аналитические материалы по оценке состояния экономической безопасности организации с применением современных цифровых инструментов для принятия руководством стратегических решений.

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

Знать:

основные источники экономических и финансовых рисков, принципы классификации экономических и финансовых рисков; основные методы проведения комплексного анализа угроз экономической безопасности;

Уметь:

составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности;

проводить анализ основных факторов внешней и внутренней среды, влияющих на результаты деятельности хозяйствующего субъекта;

Владеть:

навыками идентификации экономических и финансовых рисков.

3. Объем дисциплины (модуля).

3.1. Общая трудоемкость дисциплины (модуля).

Общая трудоемкость дисциплины (модуля) составляет 3 з.е. (108 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. №6
Контактная работа при проведении учебных занятий (всего):	60	60
В том числе:		
Занятия лекционного типа	30	30
Занятия семинарского типа	30	30

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 48 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	Место и роль экономических рисков в управлении деятельностью организаций. Система неопределенностей и принципы классификации экономических рисков. Функции экономических рисков. Внешние и внутренние факторы окружающей среды.
2	Теоретические основы анализа рисков. Сущность и основные задачи риск-менеджмента. Процесс управления риском. Математические методы оценки экономических рисков.
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. Критерии эффективности в условиях полной неопределенности.
4	Принятие оптимального решения в условиях экономического кризиса. Статистические методы принятия решений в условиях риска. Выбор оптимального плана методом построения деревьев событий: «дерево решений», оптимизация стратегии выхода на рынок.
5	Основные методы воздействия на экономические риски Общие принципы управления риском: схема процессов управления риском, примеры рисков, приемы управления риском. Диверсификация. Страхование риска.

4.2. Занятия семинарского типа.

Практические занятия

№ п/п	Тематика практических занятий/краткое содержание
1	Место и роль экономических рисков в управлении деятельностью организаций. Построение системы классификации экономических рисков хозяйствующего субъекта. Анализ внешних факторов бизнес-окружения хозяйствующего субъекта. Анализ внутренних факторов бизнес-окружения хозяйствующего субъекта.
2	Теоретические основы анализа рисков. Сущность и основные задачи риск-менеджмента. Процесс управления риском. Математические методы оценки экономических рисков. Оценка риска на основе анализа финансовых показателей деятельности предприятия. Разработка рекомендаций по формированию системы управления рисками.
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. Критерии эффективности в условиях полной неопределенности.
4	Принятие оптимального решения в условиях экономического кризиса. Статистические методы принятия решений в условиях риска. Выбор оптимального плана методом построения деревьев событий: «дерево решений», оптимизация стратегии выхода на рынок.
5	Основные методы воздействия на экономические риски.

№ п/п	Тематика практических занятий/краткое содержание
	Общие принципы управления риском: схема процессов управления риском, примеры рисков, приемы управления риском. Диверсификация. Страхование риска. Выбор и применение приемов управления риском.

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 докладов
5	Работа с заданиями
6	Подготовка к промежуточной аттестации.
7	Подготовка к текущему контролю.

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

№ п/п	Библиографическое описание	Место доступа
1	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	ЭБС Юрайт URL: https://urait.ru/bcode/468977
2	Управление рисками: учебник и практикум для вузов. А. В. Воронцовский. — 2-е изд — Москва: Издательство Юрайт , 2021	ЭБС Юрайт URL: https://urait.ru/bcode/469401
3	Управление финансовыми рисками: учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры. И. П. Хоминич [и др.]; под редакцией И. П. Хоминич, И. В. Пещанской. — Москва: Издательство Юрайт , 2019	ЭБС Юрайт URL: https://urait.ru/bcode/433674
4	Риск-менеджмент: учебник. В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. Москва: Издательство Юрайт , 2021	ЭБС Юрайт URL: https://urait.ru/bcode/469020
5	Безопасность предпринимательской деятельности: учебник для вузов. В. Л. Шульц, А. В. Юрченко, А. Д. Рудченко; под редакцией В. Л. Шульца. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва: Издательство Юрайт , 2020	ЭБС Юрайт URL: https://urait.ru/bcode/447405

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>

Электронная библиотечная система «Юрайт», доступ для студентов и преподавателей РУТ (МИИТ): <https://www.urait.ru>

Федеральная служба государственной статистики: <https://www.gks.ru>

Официальный сайт Международного валютного фонда: <https://www.imf.org/>

Официальный сайт Банка России: <https://www.cbr.ru/>

Финансовый портал «Финам.ру»: <https://www.finam.ru/>

Официальный сайт Министерства экономического развития РФ [Электронный ре-сурс]. – Режим доступа: <http://www.economy.gov.ru>

Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики [Электрон-ный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.gks.ru>

Официальный сайт Центра макроэкономического анализа и краткосрочного прогнозирования [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.forecast.ru/>

Официальный сайт Экономической экспертной группы [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.eeg.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 6 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»

Коришева Ольга
Викторовна

Лист согласования

Заведующий кафедрой ФК

З.П. Межох

Председатель учебно-методической
комиссии

М.В. Ишханян