

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)

Управление экономическими рисками

Направление подготовки: 38.04.01 Экономика

Направленность (профиль): Финансовая экономика

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: 22.03.2022

1. Общие сведения о дисциплине (модуле).

Целями изучения дисциплины являются приобретение обучающимися основных знаний об экономических рисках, которым подвергаются хозяйствующие субъекты в процессе осуществления своей деятельности и освоение основных методов анализа, оценки и воздействия на экономические риски.

Задачи освоения дисциплины:

- формирование у обучающихся комплекса знаний об экономической сущности понятий «неопределенность» и «риск»;
- освоение обучающимися методов анализа и оценки экономических рисков;
- освоение обучающимися методов воздействия на экономические риски;
- формирование у обучающихся навыков выбора наиболее эффективных методов по управлению экономическими рисками;
- приобретение обучающимися навыков самостоятельной работы с научно-экономической литературой по управлению экономическими рисками.

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-хозяйственной деятельности, выявлять проблемы валютного, кредитного и финансового характера с применением современных цифровых инструментов при анализе практических ситуаций, возникающих в сфере финансово-экономических отношений;

ПК-2 - Способен применять методы цифрового экономического анализа для совершенствования финансово-экономической деятельности .

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

Знать:

- основные положения теории по управлению экономическими рисками;
- методы анализа и оценки экономических рисков;
- основные подходы к управлению экономическими рисками.

Уметь:

- осуществлять поиск, сбор и анализ необходимой информации для выявления и управления экономическими рисками на предприятиях;

- экономически правильно формулировать постановку задач и конкретно формализовать в виде соответствующей экономико-управленческой модели на основе положений теории управления экономическими рискам;
- выбирать из изученных методов необходимый метод исследования количественных и качественных характеристик экономических рисков.

Владеть:

- навыками идентификации и оценки экономических рисков;
- способностью проводить самостоятельные исследования по оценке влияния на финансово-хозяйственные результаты деятельности хозяйствующего субъекта рискообразующих факторов валютного, кредитного и финансового характера используя современные методы цифрового экономического анализа.

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	Сем. №2
Контактная работа при проведении учебных занятий (всего):	56	56
В том числе:		
Занятия лекционного типа	28	28
Занятия семинарского типа	28	28

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 124 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	<p>Сущность риска деятельности хозяйствующего субъекта как экономической категории.</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Риск как экономическая категория и явление в рыночной системе хозяйства. - Подходы к классификации рисков. - Российские и международные стандарты управления рисками, основные понятия.
2	<p>Развитие концепций управления рисками.</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Обзор российских и международных стандартов управления рисками. - Стандарты ГОСТ/ИСО, COSO 2004 и COSO 2017, FERMA и др.
3	<p>Основные принципы построения и ключевые факторы эффективности функционирования систем управления рисками.</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Элементы системы риск-менеджмента и взаимосвязи между ними. - Формирование инфраструктуры и внутренней среды управления рисками.
4	<p>Оценка экономических рисков хозяйствующего субъекта.</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Идентификация рисков: способы и правила выявления экономических рисков. - Методы и средства идентификации рисков.
5	<p>Оценка экономических рисков хозяйствующего субъекта.</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Качественная оценка рисков. - Экспертные методы. - Принципы и правила проведения экспертной оценки рисков.
6	<p>Оценка экономических рисков хозяйствующего субъекта.</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Количественные методы оценки риска. - Основы математического анализа и статистики при проведении количественной оценки рисков. - Оценка последствий: структура ущерба.
7	<p>Оценка экономических рисков хозяйствующего субъекта.</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Методы количественной оценки рисков и их влияния на цели компании. - Анализ чувствительности. - Анализ сценариев. - Имитационное моделирование рисков проекта (Метод Монте-Карло).

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
8	Оценка экономических рисков хозяйствующего субъекта. Рассматриваемые вопросы: - Матрицы последствий и матрицы рисков.
9	Построение карты рисков и риск-аппетит. Рассматриваемые вопросы: - Построение карты рисков. - Риск-аппетит в условиях неопределенности.
10	Выбор стратегий и методов управления рисками. Рассматриваемые вопросы: - Стратегии и методы воздействия на риски. - Система внутреннего контроля. - Установление критериев эффективности управления риском.
11	Выбор стратегий и методов управления рисками. Рассматриваемые вопросы: - Оценка остаточного уровня рисков и определение вторичных рисков. - Подготовка и внедрение планов управления риском.
12	Мониторинг управления рисками. Рассматриваемые вопросы: - Мониторинг рисков: инвентаризация и переоценка. - Мониторинг и анализ эффективности применения выбранных методов управления риском.
13	Формирование системы управления экономическими рисками хозяйствующего субъекта. Рассматриваемые вопросы: - Научное толкование понятия «риск-менеджмент». - Основные способы воздействия на риск.
14	Формирование системы управления экономическими рисками хозяйствующего субъекта. Рассматриваемые вопросы: - Организационно-методические принципы, формирующие систему управления экономическими рисками хозяйствующего субъекта. - Проблемы прогнозирования и управления экономическими рисками на предприятиях транспорта.

4.2. Занятия семинарского типа.

Практические занятия

№ п/п	Тематика практических занятий/краткое содержание
1	Изучение научных подходов к классификации экономических рисков, в т.ч. на примере деятельности транспортных компаний. В результате работы на практическом занятии студент получает навык по построению классификационной схемы экономических рисков на примере деятельности транспортных компаний.
2	Сравнение отечественных и международных стандартов управления рисками. В результате работы на практическом занятии студент проводит сравнительный анализ отечественных и международных стандартов риск-менеджмента и определяет ключевые этапы применения стандартов управления рисками.
3	Современные способы выявления экономических рисков. В результате работы на практическом занятии студент учится на конкретном примере применять методические подходы и практические рекомендации для определения источников рисков

№ п/п	Тематика практических занятий/краткое содержание
	хозяйственной деятельности транспортных компаний при выполнении процедур идентификации экономических рисков.
4	Качественные методы оценки риска. В результате работы на практическом занятии студент получает навык выбора оптимальной методики качественного исследования экономических рисков на примере деятельности транспортных компаний.
5	Количественные методы оценки риска. В результате работы на практическом занятии студент определяют размеры отдельных рисков и их влияние на стоимость транспортной компании на конкретном примере.
6	Построение матрицы последствий и матрицы рисков. В результате работы на практическом занятии студент получает навык построения матрицы последствий и матрицы рисков транспортной компании.
7	Построение карты рисков (анализ ситуаций). В результате работы на практическом занятии студент на конкретном примере отрабатывает умение по составлению карты рисков по двум критериям: вероятность реализации и степень ущерба.
8	Риск-аппетит в условиях неопределенности. В результате работы на практическом занятии студент на конкретном примере учится определять уровень риск-аппетита транспортной компании.
9	Научное толкование понятия «риск-менеджмент». Анализ различных точек зрения. В результате работы на практическом занятии студент проводит обобщающий анализ сведений о принципах, подходах к управлению экономическими рисками и определяет структуру основных понятий риск-менеджмента.
10	Основные способы воздействия на риск (анализ ситуаций). В результате работы на практическом занятии студент получает навык выбора оптимального способа воздействия на риск, рассматривая различные примеры.
11	Организационно-методические принципы, формирующие систему управления экономическими рисками транспортной компании. В результате работы на практическом занятии студент учится на конкретном примере разрабатывать модель управления экономическими рисками транспортной компании на стратегическом и тактическом уровнях.
12	Анализ системы управления рисками на примере транспортных предприятий (разбор конкретных ситуаций). В результате работы на практическом занятии студент проводит анализ современных подходов и систем управления рисками на примере крупных транспортных компаний.

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	Касьяненко, Т. Г. 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, 2022. — 381 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00375-8.	https://urait.ru/bcode/489052 (дата обращения: 08.03.2022). — Текст: электронный.
2	Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 485 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12206-0.	https://urait.ru/bcode/489580 (дата обращения: 08.03.2022). — Текст: электронный.
3	Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 365 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-3502-8.	https://urait.ru/bcode/489098 (дата обращения: 08.03.2022). — 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.miit.ru>;

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

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

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

Образовательная платформа «Юрайт»: <https://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:

Экзамен во 2 семестре.

10. Оценочные материалы.

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

Авторы

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

Комкова Ирина
Николаевна

Лист согласования

Заведующий кафедрой ФК

З.П. Межох

Председатель учебно-методической
комиссии

М.В. Ишханян