



Федеральное агентство морского и речного транспорта
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
**«Государственный университет морского и речного флота
имени адмирала С.О. Макарова»**
Воронежский филиал ФГБОУ ВО «ГУМРФ имени адмирала С.О. Макарова»

Кафедра экономики и менеджмента

АННОТАЦИЯ

дисциплины «Анализ и оценка рисков бизнес-проектов на транспорте»

Направление – 38.03.02 «Менеджмент»

Направленность (профиль) – Экономика и менеджмент на транспорте

Уровень высшего образования – бакалавриат

Форма обучения – очно-заочная

Промежуточная аттестация – зачет

1. Место дисциплины в структуре образовательной программы

В соответствии с учебным планом по направлению подготовки 38.03.02 «Менеджмент» дисциплина «Анализ и оценка рисков бизнес-проектов на транспорте» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений и изучается в 8 семестре 4 курса очно-заочной формы обучения.

Дисциплина базируется на знаниях и умениях, полученных обучающимися при изучении дисциплин: «Экономика предприятия», «Менеджмент», «Стратегический менеджмент», «Макроэкономика», «Финансы», «Экономика транспорта», «Ценообразование» и другие.

Успешное освоение материала дисциплины в рамках установленных компетенций необходимо для изучения следующих дисциплин: «Экономическая оценка инвестиционных проектов», «Анализ и диагностика финансово-хозяйственной деятельности», «Анализ и оптимизация бизнес-процессов на транспорте».

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Планируемые результаты обучения по дисциплине
УК-3	УК-3.3	Знать: возможные последствия личных

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Планируемые результаты обучения по дисциплине
Способен осуществлять социальное взаимодействие и реализовывать свою роль в команде	Анализ возможных последствий личных действий и их планирование для достижения заданного результата	действий и поступков, методы планирования своих действий для достижения заданного результата
		Уметь: анализировать возможные последствия личных действий и поступков, планировать свои действия для достижения заданного результата
		Владеть: способностью анализировать возможные последствия личных действий и поступков, планировать свои действия для достижения заданного результата
ПК-1 Анализ данных, связанных с выполнением показателей транспортной и производственно-хозяйственной деятельностью, в т.ч. с использованием информационно-аналитических автоматизированных систем управления, включая применение законов и методов экономики, организации труда и управления на производстве, правил оказания услуг по перевозкам пассажиров, грузов, инструкций по оформлению проездных и перевозочных документов, технических и распорядительных актов и иной технической документации	ПК-1.3 Анализ данных, связанных с выполнением показателей транспортной и производственно-хозяйственной деятельностью, в т.ч. с использованием информационно-аналитических автоматизированных систем управления, включая применение законов и методов экономики, организации труда и управления на производстве, правил оказания услуг по перевозкам пассажиров, грузов, инструкций по оформлению проездных и перевозочных документов, технических и распорядительных актов и иной технической документации	Знать современные методики анализа экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность транспорта и его предприятий Уметь выявлять и прогнозировать существующие и потенциальные проблемы хозяйственной деятельности организации, использовать навыки практических расчетов для решения поставленных экономических задач Владеть навыками решения различных экономических задач на основе осуществления аналитических расчетов

3. Объем дисциплины по видам учебных занятий

Объем дисциплины составляет 3 зачетные единицы, всего 108 часов, из которых по очно-заочной форме 24 часа составляет контактная работа

обучающегося с преподавателем (16 часов – занятия лекционного типа, 8 часов – практические занятия).

4. Основное содержание дисциплины

Анализ основных признаков, используемых для определения понятия «риск». Сущность риска как экономической категории. Объективная и субъективная стороны риска. Основные признаки, характерные для рискованной ситуации. Взаимосвязь экономических категорий «эффективность» и «риск».

Основные элементы, лежащие в основе классификации рисков. Существующие классификации инвестиционных рисков: с точки зрения предсказуемости; по характеру проявления; в зависимости от причин возникновения и возможностей устранения (компенсации) и т.д.

Основные элементы процесса принятия решений в условиях риска. Общая постановка задачи оптимизации инвестиционных решений, принимаемых в условиях риска. Обоснование выбора наилучшей инвестиционной альтернативы на основе принципов доминирования. Статистические показатели риска. Функции рискованных предпочтений.

Сущность метода анализа чувствительности. Этапы проведения анализа чувствительности. Построение матрицы чувствительности и прогнозируемости рискованных переменных. Определение предельных значений факторов риска. Достоинства и недостатки метода анализа чувствительности.

Сущность метода анализа сценариев. Этапы проведения анализа сценариев. Достоинства и недостатки метода анализа сценариев.

Сущность метода построения «деревьев» решений. Этапы построения «деревьев» решений. Достоинства и недостатки метода построения «деревьев» решений.

Сущность метода корректировки нормы дисконта. Основные методические подходы к установлению премии за риск: метод спреда (маржи); субъективная «кумулятивная» схема; метод CAPM; метод WACC. Достоинства и недостатки метода корректировки нормы дисконта.

Сущность метода достоверных эквивалентов. Оценка коэффициентов определенности и корректировка рискованных денежных потоков. Достоинства и недостатки метода достоверных эквивалентов.

Сущность метода Монте-Карло. Этапы реализации метода Монте-Карло при анализе рисков инвестиционных проектов. Достоинства и недостатки методов имитационного моделирования.

Анализ существующих подходов к оценке и учету региональных инвестиционных рисков (РИР) при обосновании эффективности инвестиций. Предложения по совершенствованию методов оценки и учета РИР при обосновании эффективности инвестиционных проектов.

Составитель: к.э.н., доцент Святодух Е.А.