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 – 38.03.01 «Экономика»

Направленность (профиль) – Экономика транспортного бизнеса

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 38.03.01 «Экономика» дисциплина «Анализ и оценка рисков бизнес-проектов на транспорте» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений и изучается в 8-м семестре 4 курса очно-заочной формы обучения.

Дисциплина базируется на знаниях и умениях, полученных обучающимися при изучении дисциплин: «Экономика предприятия», «Менеджмент», «Стратегический менеджмент», «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
ПК-1 Способен осуществлять сбор, мониторинг и обработку данных для проведения расчетов экономических показателей деятельности организации	ПК-1.2 Использование современных методов обработки информации о деятельности транспортных организаций и факторах внешней среды	Знать методики, принципы, концепции, современные практики реализации проектов и отдельных типовых задач коммерческого и технического менеджмента транспортных и производственных компаний.
		Уметь выбрать и применить методики, принципы, концепции, современные практики реализации проектов и отдельных типовых задач коммерческого и технического менеджмента транспортных и производственных компаний.
		Владеть знаниями и навыками применяемых методик, принципов, концепций, современных практик реализации проектов и отдельных типовых задач коммерческого и технического менеджмента транспортных и производственных компаний.

3. Объем дисциплины по видам учебных занятий

Объем дисциплины составляет 3 зачетные единицы, всего 108 часов, из которых по очно-заочной форме 50 часов составляет контактная работа обучающегося с преподавателем (16 часов – занятия лекционного типа, 34 часа – 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 рисковой 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 рисковых предпочтений.

Сущность метода анализа чувствительности. Этапы проведения анализа чувствительности. Построение матрицы чувствительности и прогнозируемости рисковых 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 спрэда (маржи); субъективная «кумулятивная» схема; метод CAPM; метод WACC. Достоинства и недостатки метода корректировки нормы дисконта.

Сущность метода достоверных эквивалентов. Оценка коэффициентов определенности и корректировка рисковых 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 Будкова С.В.