

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Ястребов Олег Александрович
Должность: Ректор
Дата подписания: 17.05.2024 14:31:52
Уникальный программный ключ:
ca953a0120d891083f939673078ef1a989dae18a

**Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования
«Российский университет дружбы народов имени Патриса Лумумбы»**

Экономический факультет

(наименование основного учебного подразделения (ОУП)-разработчика ОП ВО)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

АНАЛИЗ ПРОЕКТНЫХ РИСКОВ

(наименование дисциплины/модуля)

Рекомендована МССН для направления подготовки/специальности:

38.03.01 ЭКОНОМИКА

(код и наименование направления подготовки/специальности)

Освоение дисциплины ведется в рамках реализации основной профессиональной образовательной программы высшего образования (ОП ВО):

ПРОЕКТНЫЙ АНАЛИЗ И МОДЕЛИРОВАНИЕ В ЭКОНОМИКЕ

(наименование (профиль/специализация) ОП ВО)

2024 г.

1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина «Анализ проектных рисков» входит в программу бакалавриата «Проектный анализ и моделирование в экономике» по направлению 38.03.01 «Экономика» и изучается в 7 семестре 4 курса. Дисциплину реализует Кафедра экономико-математического моделирования. Дисциплина состоит из 3 разделов и 9 тем и направлена на изучение проектных рисков, их идентификации, классификации, качественного и количественного анализа, а также принятия решения по управлению проектными рисками.

Целью освоения дисциплины является изучение основных понятий риск-менеджмента, методов идентификации и анализа рисков, методов математического моделирования проектных рисков, методов управления рисками, для достижения оптимальной экономической эффективности проекта.

2. ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Освоение дисциплины «Анализ проектных рисков» направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций (части компетенций):

Таблица 2.1. Перечень компетенций, формируемых у обучающихся при освоении дисциплины (результаты освоения дисциплины)

Шифр	Компетенция	Индикаторы достижения компетенции (в рамках данной дисциплины)
ПК-2	Способность собирать, анализировать и использовать данные для решения аналитических и профессиональных задач, с применением современного программного обеспечения и информационных технологий	ПК-2.1 Анализирует решения с точки зрения достижения целевых показателей; ПК-2.2 Применяет информационные технологии в объеме, необходимом для целей бизнес-анализа; ПК-2.3 Анализирует принципиальные технические решения и технологии, предлагаемые для реализации инвестиционного проекта;
ПК-5	способность к проведению аналитического этапа экспертизы инвестиционного проекта	ПК-5.1 Оценивает эффективность каждого варианта решения как соотношения между ожидаемым уровнем использования ресурсов и ожидаемой ценностью; ПК-5.2 Выявляет, регистрирует, анализирует и классифицирует риски и разрабатывает комплекс мероприятий по их минимизации; ПК-5.3 Собирает, анализирует, систематизирует сведения и данные, документирует полные и исчерпывающие требования к проектам и процессам организации, их ресурсному окружению;
ПК-6	способность формировать экспертное заключение о возможности реализации инвестиционного проекта	ПК-6.1 Обосновывает выбор решения для реализации в составе группы экспертов; ПК-6.2 Проводит оценку эффективности решения с точки зрения выбранных критериев; ПК-6.3 Готовит экономическое обоснование о возможности реализации инвестиционного проекта;

3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОП ВО

Дисциплина «Анализ проектных рисков» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений блока 1 «Дисциплины (модули)» образовательной программы высшего образования.

В рамках образовательной программы высшего образования обучающиеся также осваивают другие дисциплины и/или практики, способствующие достижению запланированных результатов освоения дисциплины «Анализ проектных рисков».

Таблица 3.1. Перечень компонентов ОП ВО, способствующих достижению запланированных результатов освоения дисциплины

Шифр	Наименование компетенции	Предшествующие дисциплины/модули, практики*	Последующие дисциплины/модули, практики*
ПК-2	Способность собирать, анализировать и использовать данные для решения аналитических и профессиональных задач, с применением современного программного обеспечения и информационных технологий	Производственно-технологическая практика; <i>Проектное бюджетирование**</i> ; <i>Компьютерные инструменты бизнес-аналитики**</i> ; <i>Цифровая бизнес-аналитика**</i> ; <i>Компьютерные инструменты бизнес-планирования**</i> ; <i>Big Data advanced**</i> ; <i>Сторителлинг**</i> ; Финансовое моделирование инвестиционного проекта; Анализ и прогнозирование конъюнктуры рынков; Проектный анализ (Часть 1);	Преддипломная практика; Разработка интернет-проектов; Финансирование проектов; Макроэкономическое моделирование;
ПК-6	способность формировать экспертное заключение о возможности реализации инвестиционного проекта	<i>Цифровая бизнес-аналитика**</i> ; <i>Компьютерные инструменты бизнес-планирования**</i> ; Финансовое моделирование инвестиционного проекта; Анализ и прогнозирование конъюнктуры рынков;	Разработка интернет-проектов; Организация проектной деятельности; Преддипломная практика;
ПК-5	способность к проведению аналитического этапа экспертизы инвестиционного проекта	<i>Analysis of Mergers and Acquisition Projects**</i> ; <i>Анализ проектов слияния и поглощения**</i> ; <i>Проектный анализ (Часть 1)</i> ;	Преддипломная практика; Финансирование проектов; Организация проектной деятельности;

* - заполняется в соответствии с матрицей компетенций и СУП ОП ВО

** - элективные дисциплины /практики

4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ И ВИДЫ УЧЕБНОЙ РАБОТЫ

Общая трудоемкость дисциплины «Анализ проектных рисков» составляет «3» зачетные единицы.

Таблица 4.1. Виды учебной работы по периодам освоения образовательной программы высшего образования для очной формы обучения.

Вид учебной работы	ВСЕГО, ак.ч.		Семестр(-ы)
			7
<i>Контактная работа, ак.ч.</i>	34		34
Лекции (ЛК)	0		0
Лабораторные работы (ЛР)	34		34
Практические/семинарские занятия (СЗ)	0		0
<i>Самостоятельная работа обучающихся, ак.ч.</i>	56		56
<i>Контроль (экзамен/зачет с оценкой), ак.ч.</i>	18		18
Общая трудоемкость дисциплины	ак.ч.	108	108
	зач.ед.	3	3

5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Таблица 5.1. Содержание дисциплины (модуля) по видам учебной работы

Номер раздела	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела (темы)		Вид учебной работы*
Раздел 1	Классификация проектных рисков	1.1	Основы риск-менеджмента. Понятие «риск». Концепции риска: как неопределенности; как возможности; как ресурса; минимизации риска; приемлемого риска. ¶Понятие неопределенности и риска инвестиционного проекта, информационный и оценочный подходы, параметры рисков. ¶Экономические риски: возможность возникновения убытка; неопределенность, непредсказуемость, случайность реализовавшейся ситуации; нежелательность возникновения убытка; денежное измерение убытка. ¶	ЛР
		1.2	Основные принципы классификации рисков. Системы классификации рисков и Общая классификация рисков. Структурные характеристики риска: опасность; подверженность риску; уязвимость; взаимодействие с другими рисками. ¶Критерии классификации рисков по характеристике опасности: тип объекта; причина ущерба; типичность негативных последствий. ¶Критерии классификации по характеристике подверженности риску: специфика исходов; место появления рисков; степень зависимости ущерба; характер распределения бремени риска; уровень возникновения риска; уровень проявления негативных последствий. ¶Критерии классификации по характеристике уязвимости: влияние социальной и природной среды на риск; степень учета временного фактора; продолжительность выявления и ликвидации отрицательных последствий; зависимость уязвимости от времени. ¶Критерии классификации по характеристике взаимодействия с другими рисками: степень распространенности данного риска; характер влияния на различные объекты; степень диверсифицируемости риска. ¶Классификация рисков по информационным характеристикам, величине риска и расходам с ним связанным. Критерии классификации по характеристике информации имеющейся о риске: предсказуемость; тип информации; достоверность информации. ¶Критерии классификации по величине риска: частота возникновения ущерба; размер (тяжесть) ущерба. ¶Критерии классификации по характеристике расходов, связанных с риском: возможные финансовые последствия; виды расходов; характер распределения расходов. ¶Специфические классификации рисков: специфические банковские риски; страховые риски; производственные риски; торгово-закупочные риски. Однородные риски.	ЛР
Раздел 2	Классификация проектных рисков	2.1	Анализ проектных рисков. Методы оценки проектных рисков. Концепции анализа рисков:	ЛР

Номер раздела	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела (темы)		Вид учебной работы*
			<p>технократическая, экологическая, экономическая, психологическая, социологическая, страновая, военная, политическая и валютная. Три основных этапа анализ риска: идентификация, оценивание и прогноз. Методы анализа рисков подразделяют на экспертный, феноменологический, детерминистический, вероятностный, качественный и количественный. ¶Методы оценки показателя риска подразделяют на статистический, вероятностно-статистический, теоретико-вероятностный, экспертный. Инструментарий анализа рисков: метод экспертных оценок; SWOT-анализ; метод Дельфи; звезда рисков или круговая диаграмма; спираль рисков; метод проектов аналогов; метод ставки процента с поправкой на риск; метод критических значений. ¶Качественный анализ проектных рисков: структурная диаграмма; потоковая диаграмма; диаграмма Исикавы; прямая инспекция; аудит; метод построения деревьев событий; метод «события-последствия»; метод деревьев отказов; методы оценки вероятности рисков событий и последствий их наступлений. ¶Количественный анализ проектных рисков: анализ точки безубыточности; анализ чувствительности проекта; метод вариации параметров проекта; сценарный подход; имитационное моделирование; метод Монте-Карло; оценка ожидаемого эффекта. ¶Ранжирование рисков. ¶</p>	
		2.2	<p>Управление проектными рисками. Цели и задачи системы управления проектными рисками. Процесс управления проектными рисками. Инструменты управления проектными рисками: уклонение от риска; сокращение риска; принятие риска на себя; передача риска. Дособытийные и послесобытийные методы управления рисками.</p>	ЛР
		2.3	<p>Методы управления проектными рисками. Методы трансформации рисков: метод отказа от риска; метод аутсорсинга риска; метод снижения частоты ущерба или предотвращения убытка; метод уменьшения размера убытков; метод разделения риска; дифференциация (отделение) рисков; дублирование наиболее значимых объектов, подверженных риску. ¶Методы финансирования рисков. Методы реализации процедуры «Сокращение риска»: покрытия убытка из текущего дохода; покрытия убытка из резервов; покрытия убытка за счет использования займа; самострахование. ¶Методы реализации процедуры «Передача риска»: покрытия убытка на основе нестрахового пула; покрытия убытка за счет передачи ответственности на основе договора; покрытия убытка на основе поддержки государственных и/или муниципальных органов; покрытия убытка на основе спонсорства; страхование. ¶Способы снижения степени риска</p>	ЛР

Номер раздела	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела (темы)		Вид учебной работы*
			в управлении инвестиционным проектом: снижение влияния негативных событий за счет структуризации и путем управления рисками проекта.	
Раздел 3	Риски международной проектной деятельности.	3.1	Риски международных проектов. Понятие странового риска. Страновые риски иностранного коммерсанта и иностранного инвестора. Структура и составные части странового риска: коммерческий риск и некоммерческий или политический риск. ¶Понятие экономического, финансового и валютного риска. ¶Понятие политического риска. Классификация политических рисков по источнику их вызвавшему, по политическим событиям и по характеру воздействия на экономику. Способы воздействия политических рисков на международную деятельность.	ЛР
		3.2	Международная проектная деятельность и специфика проектных рисков. Стратегии международной проектной деятельности. Стимулирующие и негативные факторы международного бизнеса. Риски, связанные с различными формами организации международного бизнеса. Риски на различных стадиях развития международной деятельности. Управление международной компанией: Макропирамида, «Зонтик» и международный конгломерат.	ЛР
		3.3	Оценка международных проектных рисков. Методы выявления и техника анализа рисков международных проектов. Глобальный анализ странового риска основан на изучении четырех групп факторов; политических; социальных; экономических и правовых. Качественные методы анализа странового риска "old hands" ("старых связей") и "grand tours" ("больших туров"). Комбинированный подход оценки страновых рисков (Р. Руммель и Д. Хинен, GESTALT). Рейтинговые и матричные системы анализа проектных рисков. Аналитические методы оценки рисков международных проектов: специального отчета, оценки вероятности неблагоприятных событий, построения деревьев событий, деревьев отказов, "события – последствия", экспертных систем, эконометрические методы и социологический подход.	ЛР
		3.4	Управление рисками международных проектов. Методы управления рисками международных проектов: избегание риска, снижение степени риска и принятие риска. Выбор метода управления риском и оценка его эффективности. Страхование рисков. ¶Управление политическими рисками в зарубежной коммерческой деятельности. Методы внутреннего страхования политических рисков. Техника внешнего хеджирования политических рисков инвестирования. Страхование прямых инвестиций от политических рисков. Внутренняя техника хеджирования	ЛР

Номер раздела	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела (темы)	Вид учебной работы*
		политических рисков инвестирования. ¶Управление политическими рисками международных банковских займов: ограничения займов рискованным странам; передача риска правительственным агентствам; различного рода долговые свопы; налоговые льготы; обратный выкуп долгов. ¶Управление валютными рисками. Оценка величины валютного риска. Пути решения проблемы валютного риска: стратегии непокрытия валютных рисков, полного хеджирования валютных рисков и избирательного хеджирования валютных рисков. Внутренние методы и процедуры для управления валютным риском. Внешнее хеджирование валютного риска. ¶Управление ценовыми рисками. Способы фиксации цен в международных контрактах и ценовой риск. Хеджирование ценового риска на рынке срочных контрактов. Хеджирование цены с помощью форвардных контрактов и свопов. Хеджирование на рынке фьючерсных контрактов.	

* - заполняется только по **ОЧНОЙ** форме обучения: ЛК – лекции; ЛР – лабораторные работы; СЗ – практические/семинарские занятия.

6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Таблица 6.1. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Тип аудитории	Оснащение аудитории	Специализированное учебное/лабораторное оборудование, ПО и материалы для освоения дисциплины (при необходимости)
Компьютерный класс	Компьютерный класс для проведения занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, оснащенная персональными компьютерами (в количестве 1 шт.), доской (экраном) и техническими средствами мультимедиа презентаций.	Компьютер, проектор, экран и доска. ПО: Word; Exce; PowerPoint; СПС Гарант; КонсультантПлюс.
Для самостоятельной работы	Аудитория для самостоятельной работы обучающихся (может использоваться для проведения семинарских занятий и консультаций), оснащенная комплектом специализированной мебели и компьютерами с доступом в ЭИОС.	Компьютер, проектор, экран, доска и доступ в интернет.

* - аудитория для самостоятельной работы обучающихся указывается **ОБЯЗАТЕЛЬНО!**

7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Основная литература:

1. 1. Грачева, М. В. Риск-менеджмент инвестиционного проекта: Учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / Под ред. Грачева М.В. - М.:ЮНИТИ-ДАНА, 2015. - 544 с., ISBN 978-5-238-01506-4
<http://znanium.com/bookread2.php?book=882522&spec=1>
2. 2. Грачева, М. В. Управление рисками в инновационной деятельности: Учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / Грачева М.В., Ляпина С.Ю. - М.:ЮНИТИ-ДАНА, 2015. - 351 с., ISBN 978-5-238-01693-1
<http://znanium.com/bookread2.php?book=883754&spec=1>
- 3. Количественные методы в экономических исследованиях: Учебник для студентов вузов, обучающихся по специальности экономики и управления / Под ред. Грачева М.В., - 2-е изд., перераб. и доп. - М.:ЮНИТИ-ДАНА, 2015. - 687 с., ISBN 978-5-238-02331-1 <http://znanium.com/bookread2.php?book=884326&spec=1>
- 4. Дегтярева, О.И. Управление рисками в международном бизнесе [Электронный ресурс] : учебник / О.И. Дегтярева .— 3-е изд., стер. — М. : ФЛИНТА, 2014 .— 342 с. — (Экономика и управление) .— ISBN 978-5-9765-0156-0 .— Режим доступа: <https://rucont.ru/efd/316437>

Дополнительная литература:

1. 5. Сорокин Л.В. Управление рисками проектов: Учебное пособие / Под общ. ред. В.М. Матюшка. – М.: РУДН, 2010. – 108 с. - (Развитие научного потенциала высшей школы (2009-2010 годы). - ISBN 978-5-209-03539-8 (Фонд библиотеки РУДН, 28 экз.)
2. 6. Управление проектами: Учебное пособие / Под ред. В.М. Матюшка. – М.: РУДН, 2010. – 553 с. : ил. - (Развитие научного потенциала высшей школы (2009-2010 годы)). - ISBN 978-5-209-03896-2
http://lib.rudn.ru/MegaPro/UserEntry?Action=Rudn_FindDoc&id=343122&idb=0
- Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:*

1. ЭБС РУДН и сторонние ЭБС, к которым студенты университета имеют доступ на основании заключенных договоров
- Электронно-библиотечная система РУДН – ЭБС РУДН
<http://lib.rudn.ru/MegaPro/Web>
 - ЭБС «Университетская библиотека онлайн» <http://www.biblioclub.ru>
 - ЭБС Юрайт <http://www.biblio-online.ru>
 - ЭБС «Консультант студента» www.studentlibrary.ru
 - ЭБС «Троицкий мост»
2. Базы данных и поисковые системы
- электронный фонд правовой и нормативно-технической документации
<http://docs.cntd.ru/>
 - поисковая система Яндекс <https://www.yandex.ru/>
 - поисковая система Google <https://www.google.ru/>
 - реферативная база данных SCOPUS
<http://www.elsevier.com/locate/scopus/>

Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся при освоении дисциплины/модуля:*

1. Курс лекций по дисциплине «Анализ проектных рисков».

* - все учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся размещаются в соответствии с действующим порядком на странице дисциплины **в ТУИС!**

8. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ И БАЛЛЬНО-РЕЙТИНГОВАЯ СИСТЕМА ОЦЕНИВАНИЯ УРОВНЯ СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Оценочные материалы и балльно-рейтинговая система* оценивания уровня сформированности компетенций (части компетенций) по итогам освоения дисциплины «Анализ проектных рисков» представлены в Приложении к настоящей Рабочей программе дисциплины.

* - ОМ и БРС формируются на основании требований соответствующего локального нормативного акта РУДН.

РАЗРАБОТЧИК:

Доцент кафедры экономико-
математического
моделирования

Должность, БУП

Подпись

Сорокин Леонид
Владимирович

Фамилия И.О.

РУКОВОДИТЕЛЬ БУП:

Заведующий кафедрой
экономико-математического
моделирования

Должность БУП

Подпись

Балашова Светлана
Алексеевна

Фамилия И.О.

РУКОВОДИТЕЛЬ ОП ВО:

Заведующий кафедрой

Должность, БУП

Подпись

Балашова Светлана
Алексеевна

Фамилия И.О.