

ФЕДЕРАЛЬНОЕ АГЕНТСТВО ЖЕЛЕЗНОДОРОЖНОГО ТРАНСПОРТА
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования «Петербургский государственный университет путей сообщения
Императора Александра I»
(ФГБОУ ВО ПГУПС)

Кафедра «Экономика транспорта»

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА
дисциплины
Б1.В.9 «ТЕОРИЯ И МЕТОДОЛОГИЯ АНАЛИЗА РИСКОВ»
для направления подготовки
38.03.01 «Экономика»

по профилю
«Управление рисками и экономическая безопасность»

Форма обучения – очная

Санкт-Петербург
2025

ЛИСТ СОГЛАСОВАНИЙ

Рабочая программа рассмотрена и утверждена на заседании кафедры «Экономика транспорта»
Протокол № 6 от 09 января 2025 г.

Заведующий кафедрой
«Экономика транспорта»
09 января 2025 г.

М.Г. Григорян

СОГЛАСОВАНО

Руководитель ОПОП
09 января 2025 г.

Л.М. Чеченова

1. Цели и задачи дисциплины

Рабочая программа дисциплины «*Теория и методология анализа рисков*» (Б1.В.9) (далее – дисциплина) составлена в соответствии с требованиями федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика» (далее – ФГОС ВО), утвержденного 12 августа 2020 г., приказ Министерства науки и высшего образования № 954; с учетом профессионального стандарта (08.018) «Специалист по управлению рисками», утвержденного 30.08.2018 г., приказ Министерства труда и социальной защиты РФ N 564н.

Целью изучения дисциплины является приобретение теоретических знаний в области управления рисками: представлений о методах и инструментах анализа рисков, их последствий, воздействия на риски и контроля рисков, базовых знаний о нормативных документах, национальных и международных стандартах в области управления рисками; умений определять эффективные методы анализа и воздействия на риски с учетом отраслевой специфики; навыков разработки мероприятий по управлению рисками.

Для достижения цели дисциплины решаются следующие задачи:

- ознакомление с теоретико-методологическими основами управления рисками;
- изучение методов и инструментов анализа рисков, оценки их последствий;
- формирование знаний о методах и инструментах воздействия на риски, мониторинга рисков, разработки плана мероприятий по управлению рисками;
- изучение законодательства РФ, национальных и международных стандартов в сфере управления рисками;
- приобретение умений и навыков определения эффективных методов воздействия на риск, в т.ч. с учетом отраслевой специфики;
- овладение навыками разработки и внедрения планов воздействия на риски;
- овладение навыками разработки и мониторинга мероприятий по управлению рисками.

2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с установленными в образовательной программе индикаторами достижения компетенций

Планируемыми результатами обучения по дисциплине (модулю) является формирование у обучающихся компетенций и/или части компетенций. Сформированность компетенций и/или части компетенций оценивается с помощью индикаторов достижения компетенций.

Индикаторы достижения компетенций	Результаты обучения по дисциплине (модулю)
ПК-3. Выработка мероприятий по воздействию на риск в разрезе отдельных видов и их экономическая оценка	
ПК-3.1.1. Знает методы воздействия на риски и критерии, применяемые при выработке мероприятий по воздействию на риски в разрезе отдельных видов	<i>Обучающийся знает:</i> <ul style="list-style-type: none">– базовые методы и инструменты воздействия на риски (с учетом специфики риска)
ПК-3.1.2. Знает инструменты анализа существующих методов контроля рисков и управления рисками и их достаточности; инструменты	<i>Обучающийся знает:</i> <ul style="list-style-type: none">– методический аппарат анализа рисков в рамках теории управления рисками;– методы и инструменты контроля рисков и оценки их последствий

Индикаторы достижения компетенций	Результаты обучения по дисциплине (модулю)
анализа последствий рисков	
ПК-3.1.3. Знает принципы и правила выбора метода, техники оценки риска (достаточность ресурсов, характер и степень неопределенности, сложность метода, техники), методы, техники, технологии управления различными видами риска	<p><i>Обучающийся знает:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> – теоретические основы выбора инструментов и методов анализа и оценки различных видов рисков в условиях неопределенности
ПК-3.1.4. Знает возможности инструментов риск-менеджмента для анализа рисков организации, методы воздействия на риск, план мероприятий по управлению рисками	<p><i>Обучающийся знает:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> – инструментарий управления рисками в части идентификации и оценки рисков; – методы воздействия на риск; – теоретические основы разработки плана по управлению рисками
ПК-3.1.6. Знает методы и инструменты, применяемые для предупреждения рисков несоответствия законодательству Российской Федерации и регуляторным требованиям	<p><i>Обучающийся знает:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> – базовые методы и инструменты предупреждения рисков, в том числе правовых (регуляторных) рисков
ПК-3.1.7. Знает законодательство Российской Федерации, отраслевые стандарты по управлению рисками, базовые положения международных стандартов по риск-менеджменту и смежным вопросам	<p><i>Обучающийся знает:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> – законодательство РФ, национальные (в т.ч. отраслевые) и международные стандарты в сфере управления рисками
ПК-3.2.1. Умеет определять эффективные методы воздействия на риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственным за риск сотрудникам в правильной оценке риска и разработке мероприятий по их управлению	<p><i>Обучающийся умеет:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> – проводить оценку рисков; – находить эффективные решения воздействия на риск; – находясь в команде владельца риска, принимать участие в разработке и внедрении плана мероприятий по управлению рисками
ПК-3.2.2. Умеет осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики, отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды рисков и эффективно	<p><i>Обучающийся умеет:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> – выбирать наиболее эффективные (в т.ч. с экономической точки зрения) методы воздействия на риск с учетом отраслевой специфики

Индикаторы достижения компетенций	Результаты обучения по дисциплине (модулю)
применять их с учетом их результативности и экономической эффективности	
ПК-3.3.2. Имеет навыки разработки мероприятий по управлению рисками совместно с ответственными за риск сотрудниками организации - владельцами риска, мониторинга рисков и мониторинга мероприятий по воздействию на риски	<i>Обучающийся имеет навыки:</i> – разработки мероприятий по управлению рисками; – мониторинга рисков, мониторинга и контроля мероприятий по воздействию на риск

3. Место дисциплины в структуре основной профессиональной образовательной программы

Дисциплина относится к части, формируемой участниками образовательных отношений блока 1 «Дисциплины (модули)».

4. Объем дисциплины и виды учебной работы

Вид учебной работы	Всего часов
Контактная работа (по видам учебных занятий)	64
В том числе:	
– лекции (Л)	32
– практические занятия (ПЗ)	32
– лабораторные работы (ЛР)	-
Самостоятельная работа (СРС) (всего)	80
Контроль	36
Форма контроля (промежуточной аттестации)	Э, КР
Общая трудоемкость: час / з.е.	180/5

Примечание: «Форма контроля» – экзамен (Э), курсовая работа (КР).

5. Структура и содержание дисциплины

5.1. Разделы дисциплины и содержание рассматриваемых вопросов

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела	Индикаторы достижения компетенций
1	Теоретико-методологические основы анализа и оценки рисков	Лекция 1. Сущность, основные понятия, положения и принципы идентификации, анализа и оценки рисков в рамках теории рисков (4 час.).	ПК-3.1.2 ПК-3.1.3 ПК-3.1.4
		Лекция 2. Законодательство РФ, национальные и международные стандарты в области управления рисками.	ПК-3.1.7.
		Лекция 3. Методический аппарат анализа рисков: содержание и задачи анализа рисков,	ПК-3.1.2 ПК-3.1.3

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела	Индикаторы достижения компетенций
		области применения отдельных методов анализа.	
		Лекция 4. Методический аппарат анализа рисков: методы и инструменты анализа и оценки рисков (6 час.).	ПК-3.1.2 ПК-3.1.4
		Лекция 5. Методический аппарат анализа рисков: методы и инструменты анализа последствий рисков.	ПК-3.1.2
		Лекция 6. Методы предупреждения рисков.	ПК-3.1.6
		Практическое занятие 1. Сущность, основные понятия, положения и принципы идентификации, анализа и оценки рисков в рамках теории рисков (4 час.)	ПК-3.1.2 ПК-3.1.3 ПК-3.1.4
		Практическое занятие 2. Национальные (в т.ч. отраслевые) стандарты в сфере управления рисками.	ПК-3.1.7.
		Практическое занятие 3. Содержание и область применения отдельных методов анализа рисков.	ПК-3.1.2 ПК-3.1.3
		Практическое занятие 4. Методы и инструменты анализа и оценки рисков (6 час.).	ПК-3.1.2 ПК-3.1.4
		Практическое занятие 5. Методы и инструменты анализа последствий рисков.	ПК-3.1.2
		Практическое занятие 6. Базовые методы и инструменты предупреждения правовых (регуляторных рисков).	ПК-3.1.6
		<p>Самостоятельная работа.</p> <ul style="list-style-type: none"> – Изучить национальные стандарты: <ol style="list-style-type: none"> 1. ГОСТ Р 51897-2011/Руководство ИСО 73:2009 «Менеджмент риска. Термины и определения», Приказ № 548-ст от 16.11.2011 г. https://rags.ru/gosts/gost/51596/ — Режим доступа: свободный. 2. ГОСТ Р ИСО/МЭК 31010-2011 «Менеджмент риска. Методы оценки риска», Приказ № 680-ст от 01.12.2011 г. http://smk.ssuwt.ru/_media/megdunar_ros_stand/gost_r_iso_31010_2011.pdf — Режим доступа: свободный. – Выполнить теоретическое исследование согласно индивидуальному заданию на курсовую работу (см. часть I в методических указаниях по выполнению курсовой работы по дисциплине «Теория и методология анализа рисков»). 	ПК-3.1.2 ПК-3.1.3 ПК-3.1.4 ПК-3.1.7

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела	Индикаторы достижения компетенций
		<p>Режим доступа: свободный.</p> <p>2. Функциональная стратегия управления рисками в холдинге "РЖД", Распоряжение № 1494р от 26.07.12 https://cssrzd.ru/orders/919_ot_26_iyulya_2012_g_n_1494r1_doc.php</p> <p>Режим доступа: свободный.</p> <ul style="list-style-type: none"> – Выполнить практические задания согласно индивидуальному заданию на курсовую работу (см. часть II в методических указаниях по выполнению курсовой работы по дисциплине «Теория и методология анализа рисков») 	

5.2. Разделы дисциплины и виды занятий

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Л	ПЗ	ЛР	СРС	Всего
1	Теоретико-методологические основы анализа и оценки рисков	18	18	-	44	80
2	Инструменты и методы воздействия на риски	14	14	-	36	64
	Итого	32	32	-	80	144
					Контроль	36
					Всего (общая трудоемкость, час.)	180

6. Оценочные материалы для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

Оценочные материалы по дисциплине являются неотъемлемой частью рабочей программы и представлены отдельным документом, рассмотренным на заседании кафедры и утвержденным заведующим кафедрой.

7. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Порядок изучения дисциплины следующий:

1. Освоение разделов дисциплины производится в порядке, приведенном в разделе 5 «Содержание и структура дисциплины». Обучающийся должен освоить все разделы дисциплины, используя методические материалы дисциплины, а также учебно-методическое обеспечение, приведенное в разделе 8 рабочей программы.

2. Для формирования компетенций обучающийся должен представить выполненные задания, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, предусмотренные текущим контролем успеваемости (см. оценочные материалы по дисциплине).

3. По итогам текущего контроля успеваемости по дисциплине, обучающийся должен пройти промежуточную аттестацию (см. оценочные материалы по дисциплине).

8. Описание материально-технического и учебно-методического обеспечения, необходимого для реализации образовательной программы по дисциплине

8.1. Помещения представляют собой учебные аудитории для проведения учебных занятий, предусмотренных программой бакалавриата, укомплектованные специализированной учебной мебелью и оснащенные оборудованием и техническими средствами обучения, служащими для представления учебной информации большой аудитории: настенным экраном (стационарным или переносным), маркерной доской и (или) меловой доской, мультимедийным проектором (стационарным или переносным).

Все помещения, используемые для проведения учебных занятий и самостоятельной работы, соответствуют действующим санитарным и противопожарным нормам и правилам.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду университета.

8.2. Университет обеспечен необходимым комплектом лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства:

- MS Office;
- Операционная система Windows;
- Антивирус Касперский;
- Программная система для обнаружения текстовых заимствований в учебных и научных работах «Антиплагиат.ВУЗ».

8.3. Обучающимся обеспечен доступ (удаленный доступ) к современным профессиональным базам данных:

- Электронно-библиотечная система издательства «Лань». [Электронный ресурс]. – URL: <https://e.lanbook.com/> — Режим доступа: для авториз. пользователей;
- Электронно-библиотечная система ibooks.ru («Айбукс»). – URL: <https://ibooks.ru/> — Режим доступа: для авториз. пользователей;
- Электронная библиотека ЮРАЙТ. – URL: <https://urait.ru/> — Режим доступа: для авториз. пользователей;
- Единое окно доступа к образовательным ресурсам - каталог образовательных интернет-ресурсов и полнотекстовой электронной учебно-методической библиотеке для общего и профессионального образования». – URL: <http://window.edu.ru/> — Режим доступа: свободный.
- Словари и энциклопедии. – URL: <http://academic.ru/> — Режим доступа: свободный.
- Научная электронная библиотека "КиберЛенинка". – URL: <http://cyberleninka.ru/> — Режим доступа: свободный.

8.4. Обучающимся обеспечен доступ (удаленный доступ) к информационным справочным системам:

- Национальный Открытый Университет "ИНТУИТ". Бесплатное образование. [Электронный ресурс]. – URL: <https://intuit.ru/> — Режим доступа: свободный.

8.5. Перечень печатных и электронных изданий, используемых в образовательном процессе:

- Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч.: учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 211 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02606-1. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт. — URL: <https://urait.ru/bcode/451702> — Режим доступа: для авториз. пользователей.
- Воронцовский, А. В. Оценка рисков : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 179 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02411-1. — Текст: электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/471513> - Режим доступа: для авториз. пользователей.

- Воронцовский, А. В. Управление рисками: учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 485 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12206-0. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт

- [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/469401> - Режим доступа: для авториз. пользователей.
- Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент: учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2021. — 365 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-3502-8. — Текст: электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/469020> - — Режим доступа: для авториз. пользователей.
 - 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, 2021. — 381 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00375-8. — Текст: электронный // ЭБС Юрайт — URL: <https://urait.ru/bcode/468977> — Режим доступа: для авториз. пользователей.
 - Марченко, Б. И. Анализ риска: основы управления рисками: учебное пособие / Б. И. Марченко. — Ростов-на-Дону: ЮФУ, 2019. — 122 с. — ISBN 978-5-9275-3124-0. — Текст: электронный // Лань: электронно-библиотечная система. — URL: <https://e.lanbook.com/book/141060>. — Режим доступа: для авториз. пользователей.
 - ГОСТ Р 51897-2011/Руководство ИСО 73:2009 «Менеджмент риска. Термины и определения», Приказ № 548-ст от 16.11.2011 г. Текст: электронный // URL: <http://rags.ru/gosts/gost/51596/> — Режим доступа: свободный.
 - ГОСТ Р ИСО/МЭК 31010-2011 «Менеджмент риска. Методы оценки риска», Приказ № 680-ст от 01.12.2011 г. Текст: электронный // URL: http://smk.ssuwt.ru/_media/megdunar_ros_stand/gost_r_iso_31010_2011.pdf — Режим доступа: свободный.
 - ISO 31000:2018(E) «Менеджмент риска. Руководство» Текст: электронный // URL: <https://iso-management.com/wp-content/uploads/2019/03/ISO-31000-2018.pdf> - Режим доступа: свободный.
- 8.6. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», используемых в образовательном процессе:
- Личный кабинет ЭИОС [Электронный ресурс]. – URL: my.pgups.ru — Режим доступа: для авториз. пользователей;
 - Электронная информационно-образовательная среда. [Электронный ресурс]. – URL: <https://sdo.pgups.ru> — Режим доступа: для авториз. пользователей;
 - Правовая система КонсультантПлюс. – URL:<http://www.consultant.ru/> — Режим доступа: свободный.

Разработчик рабочей программы, доцент
09 января 2025 г

В.М. Артимович