

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 мониторингам 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)
<b>ПК-3. Выработка мероприятий по воздействию на риск в разрезе отдельных видов и их экономическая оценка</b>	
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"><li>– базовые методы и инструменты воздействия на риски (с учетом специфики риска)</li></ul>
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"><li>– методический аппарат анализа рисков в рамках теории управления рисками;</li><li>– методы и инструменты контроля рисков и оценки их последствий</li></ul>

<b>Индикаторы достижения компетенций</b>	<b>Результаты обучения по дисциплине (модулю)</b>
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"> <li>– теоретические основы выбора инструментов и методов анализа и оценки различных видов рисков в условиях неопределенности</li> </ul>
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"> <li>– инструментарий управления рисками в части идентификации и оценки рисков;</li> <li>– методы воздействия на риск;</li> <li>– теоретические основы разработки плана по управлению рисками</li> </ul>
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"> <li>– базовые методы и инструменты предупреждения рисков, в том числе правовых (регуляторных) рисков</li> </ul>
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"> <li>– законодательство РФ, национальные (в т.ч. отраслевые) и международные стандарты в сфере управления рисками</li> </ul>
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"> <li>– проводить оценку рисков;</li> <li>– находить эффективные решения воздействия на риск;</li> <li>– находясь в команде владельца риска, принимать участие в разработке и внедрении плана мероприятий по управлению рисками</li> </ul>
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"> <li>– выбирать наиболее эффективные (в т.ч. с экономической точки зрения) методы воздействия на риск с учетом отраслевой специфики</li> </ul>

<b>Индикаторы достижения компетенций</b>	<b>Результаты обучения по дисциплине (модулю)</b>
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> <ul style="list-style-type: none"> <li>– разработки мероприятий по управлению рисками;</li> <li>– мониторинга рисков, мониторинга и контроля мероприятий по воздействию на риск</li> </ul>

### **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**

<b>Вид учебной работы</b>	<b>Всего часов</b>
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

<b>№ п/п</b>	<b>Наименование раздела дисциплины</b>	<b>Содержание раздела</b>	<b>Индикаторы достижения компетенций</b>
1	Теоретико-методологические основы анализа и оценки рисков	<b>Лекция 1.</b> 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
		<b>Лекция 2.</b> Законодательство РФ, национальные и международные стандарты в области управления рисками.	ПК-3.1.7.
		<b>Лекция 3.</b> 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.	
		<b>Лекция 4.</b> Методический аппарат анализа рисков: методы и инструменты анализа и оценки рисков (6 час.).	ПК-3.1.2 ПК-3.1.4
		<b>Лекция 5.</b> Методический аппарат анализа рисков: методы и инструменты анализа последствий рисков.	ПК-3.1.2
		<b>Лекция 6.</b> Методы предупреждения рисков.	ПК-3.1.6
		<b>Практическое занятие 1.</b> 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
		<b>Практическое занятие 2.</b> Национальные (в т.ч. отраслевые) стандарты в сфере управления рисками.	ПК-3.1.7.
		<b>Практическое занятие 3.</b> Содержание и область применения отдельных методов анализа рисков.	ПК-3.1.2 ПК-3.1.3
		<b>Практическое занятие 4.</b> Методы и инструменты анализа и оценки рисков (6 час.).	ПК-3.1.2 ПК-3.1.4
		<b>Практическое занятие 5.</b> Методы и инструменты анализа последствий рисков.	ПК-3.1.2
		<b>Практическое занятие 6.</b> Базовые методы и инструменты предупреждения правовых (регуляторных рисков).	ПК-3.1.6
		<p><b>Самостоятельная работа.</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>– Изучить национальные стандарты: <ol style="list-style-type: none"> <li>1. ГОСТ Р 51897-2011/Руководство ИСО 73:2009 «Менеджмент риска. Термины и определения», Приказ № 548-ст от 16.11.2011 г. <a href="https://rags.ru/gosts/gost/51596/">https://rags.ru/gosts/gost/51596/</a> — Режим доступа: свободный.</li> <li>2. ГОСТ Р ИСО/МЭК 31010-2011 «Менеджмент риска. Методы оценки риска», Приказ № 680-ст от 01.12.2011 г. <a href="http://smk.ssuwt.ru/_media/megdunar_os_stand/gost_r_iso_31010_2011.pdf">http://smk.ssuwt.ru/_media/megdunar_os_stand/gost_r_iso_31010_2011.pdf</a> — Режим доступа: свободный.</li> </ol> </li> <li>– 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»).</li> </ul>	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
2	Инструменты и методы воздействия на риски	<b>Лекция 7.</b> Воздействие на риски: организационное и методологическое обеспечение.	ПК-3.1.1
<b>Лекция 8.</b> Воздействие на риски: принципы принятия решений и критерии выбора.		ПК-3.1.1	
<b>Лекция 9.</b> Методы и инструменты воздействия на различные виды рисков (4 час.).		ПК-3.1.1 ПК-3.2.2	
<b>Лекция 10.</b> Выбор эффективных методов воздействия на риск.		ПК 3.2.1	
<b>Лекция 11.</b> Разработка и внедрение планов мероприятий по воздействию на риски.		ПК-3.3.2	
<b>Лекция 12.</b> Мониторинг и контроль мероприятий по воздействию на риск.		ПК-3.3.2	
<b>Практическое занятие 7.</b> Организация системы воздействия на риски.		ПК-3.1.1	
<b>Практическое занятие 8.</b> Воздействие на риски: принципы принятия решений и критерии выбора.		ПК-3.1.1	
<b>Практическое занятие 9.</b> Методы и инструменты воздействия на различные виды рисков (4час.).		ПК-3.1.1 ПК-3.2.2	
<b>Практическое занятие 10.</b> Выбор эффективных методов воздействия на риск.		ПК 3.2.1	
<b>Практическое занятие 11.</b> Разработка планов мероприятий воздействия на риски.		ПК-3.3.2	
<b>Практическое занятие 12.</b> Контроль и оценка эффективности мероприятий воздействия на риски.		ПК-3.3.2	
<b>Самостоятельная работа.</b> – Изучить корпоративные документы: 1. Положение о системе управления рисками ОАО «РЖД», Протокол № 22 от 07.12.2015 г. <a href="https://rly.su/ru/content/%D0%BF%D0%BE%D0%BB%D0%BE%D0%B6%D0%B5%D0%BD%D0%B8%D0%B5-%D0%BE-%D1%81%D0%B8%D1%81%D1%82%D0%B5%D0%BC%D0%B5-%D1%83%D0%BF%D1%80%D0%B0%D0%B2%D0%BB%D0%B5%D0%BD%D0%B8%D1%8F-%D1%80%D0%B8%D1%81%D0%BA%D0%B0%D0%BC%D0%B8-%D0%BE%D0%B0%D0%BE-%C2%AB%D1%80%D0%B6%D0%B4%C2%BB">https://rly.su/ru/content/%D0%BF%D0%BE%D0%BB%D0%BE%D0%B6%D0%B5%D0%BD%D0%B8%D0%B5-%D0%BE-%D1%81%D0%B8%D1%81%D1%82%D0%B5%D0%BC%D0%B5-%D1%83%D0%BF%D1%80%D0%B0%D0%B2%D0%BB%D0%B5%D0%BD%D0%B8%D1%8F-%D1%80%D0%B8%D1%81%D0%BA%D0%B0%D0%BC%D0%B8-%D0%BE%D0%B0%D0%BE-%C2%AB%D1%80%D0%B6%D0%B4%C2%BB</a> —		ПК-3.1.1 ПК-3.2.2	

№ 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  <a href="https://cssrzd.ru/orders/919_ot_26_iyulya_2012_g_n_1494r1_doc.php">https://cssrzd.ru/orders/919_ot_26_iyulya_2012_g_n_1494r1_doc.php</a>            Режим доступа: свободный.</p> <p>– 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»)</p>	

## 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
	<b>Итого</b>	<b>32</b>	<b>32</b>	<b>-</b>	<b>80</b>	<b>144</b>
<b>Контроль</b>						<b>36</b>
<b>Всего (общая трудоемкость, час.)</b>						<b>180</b>

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

Оценочные материалы по дисциплине является 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](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](http://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