

Федеральное агентство железнодорожного транспорта
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«ПЕТЕРБУРГСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПУТЕЙ
СООБЩЕНИЯ ИМПЕРАТОРА АЛЕКСАНДРА I»
(ФГБОУ ВО ПГУПС)

Кафедра «Менеджмент и маркетинг»

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины

Б1.В.14 «ТЕОРИЯ РИСКОВ И АНТИКРИЗИСНОЕ УПРАВЛЕНИЕ»

для направления подготовки /специальности

38.03.02 «Менеджмент»

по профилю

«Бизнес-менеджмент»

Санкт-Петербург

2025

ЛИСТ СОГЛАСОВАНИЙ

Рабочая программа рассмотрена и обсуждена на заседании кафедры
«Менеджмент и маркетинг»
Протокол № 5.2 от 14 января 2025 г.

Согласовано
И. о. зав. Кафедрой
14 января 2025 г.

Е. М. Ершов

Руководитель ОПОП «Бизнес-менеджмент»
14 мая 2025 г.

В. Э Кроливецкая

1. Цели и задачи дисциплины

Рабочая программа дисциплины «Теория рисков и антикризисное управление» (Б1.В.14) (далее – дисциплина) составлена в соответствии с требованиями федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки/специальности 38.03.02 «Менеджмент» (далее – ФГОС ВО), утвержденного 12 августа 2020 г., приказ Министерства образования и науки Российской Федерации № 970 и профстандарта 08.037 «Бизнес-аналитик», утв. приказом Министерства труда и социальной защиты Российской Федерации от 25 сентября 2018 года N 592н (в редакции, введенной в действие с 20 января 2019 года приказом Минтруда России от 14 декабря 2018 года N 807н.)

Целью дисциплины является формирование компетенций у обучающихся по выявлению рисков, анализа социально-экономических процессов, происходящих в обществе, использования информации, необходимой для антикризисного управления; разработки комплекса мероприятий по диагностике, предупреждению, нейтрализации и преодолению кризисных явлений на предприятии.

Для достижения цели дисциплины решаются следующие задачи:

- Формирование у обучающихся знаний в области методов сбора, анализа, систематизации и анализа информации, необходимой для оценки рисков в бизнес-среде;
- формирование умений проводить внутрифирменный анализ финансово-экономического состояния предприятия; выявлять и анализировать риски, а также и разрабатывать комплекс мероприятий по их минимизации.
- выработка практических навыков и умений в использование производных финансовых инструментов для хеджирования различных рисков.

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.

В рамках изучения дисциплины (модуля) осуществляется практическая подготовка обучающихся к будущей профессиональной деятельности. Результатом обучения по дисциплине является формирования у обучающихся практических навыков.

Индикаторы достижения компетенций	Результаты обучения по дисциплине (модулю)
ПК-2.1.3 Знает методы сбора, анализа, систематизации, хранения и поддержания в актуальном состоянии информации бизнес-анализа	Обучающийся знает: <ul style="list-style-type: none">– методы сбора, анализа, систематизации, хранения и поддержания в актуальном состоянии информации бизнес-анализа- специфику сбора бизнес-информации для оценки рисков и методики расчета риска инвестиционных проектов бизнеса;- методику расчета риска, рекомендованную Всемирным

Индикаторы достижения компетенций	Результаты обучения по дисциплине (модулю)
	Банком. - Зарубежный опыт антикризисного управления.
ПК-1.2.1 Умеет выявлять, регистрировать, анализировать и классифицировать риски, а также и классифицировать риски и разрабатывать комплекс мероприятий по управлению ими	Обучающийся умеет: - проводить внутрифирменный анализ финансово-экономического состояния предприятия; - выявлять, анализировать и классифицировать риски, а также использовать существующие методы для минимизации рисков бизнеса. - Использовать производные финансовые инструменты для хеджирования краткосрочных и долгосрочных денежных позиций.
ПК-1.2.5 Умеет анализировать внутренние (внешние) факторы и риски, влияющие на деятельность организации	Обучающийся умеет: - анализировать внутренние (внешние) факторы и условия, влияющие на деятельность организации с целью выявления причин кризиса; - применять официальную методику «Порядок анализа причин неплатежеспособности предприятий»

3. Место дисциплины в структуре основной профессиональной образовательной программы

Дисциплина относится к обязательной части блока 1 «Дисциплины (модули)».

4. Объем дисциплины и виды учебной работы

Для очной формы обучения:

Вид учебной работы	Всего часов	Семестр
		6
Контактная работа (по видам учебных занятий)	64	64
В том числе:		
– лекции (Л)	32	32
– практические занятия (ПЗ)	32	32
– лабораторные работы (ЛР)	-	-
Самостоятельная работа (СРС) (всего)	40	40
Контроль	4	4
Форма контроля знаний	3	3
Общая трудоемкость: час / з. е.	108/3	108/3

Для очно-заочной формы обучения:

Вид учебной работы	Всего часов	Семестр
		6
Контактная работа (по видам учебных занятий)	32	32
В том числе:		
– лекции (Л)	16	16
– практические занятия (ПЗ)	16	16
– лабораторные работы (ЛР)	-	-
Самостоятельная работа (СРС) (всего)	72	42
Контроль	4	4
Форма контроля знаний	3	3
Общая трудоемкость: час / з. е.	108/3	108/3

5. Содержание и структура дисциплины

5.1 Содержание дисциплины

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела	Индикаторы достижения компетенций
1	Риски в экономике. Понятие риска	1.1. Понятие риска. 1.2. Управление рисками. 1.3. Соотношение риска и вознаграждения. 1.4. Типологии рисков. 1.5. Задачи риск-менеджмента.	ПК-2.1.3
2	Корпоративный риск-менеджмент	2.1 Теоретические аспекты управления рисками 2.2 Риск-менеджмент на практике 2.3 Разработка и внедрение стратегии управления рисками 2.4 Корпоративное руководство и управление рисками 2.5 Подход к оценке кредитного риска на основе внутренних рейтингов	ПК-1.2.1
3	Риск и доходность	3. Соотношение риска и доходности 3.1. Расчет риска на основе анализа сценариев 3.1 Расчет риска на основе «дерева вероятностей»	ПК-1.2.5
4	Банковский риск-менеджмент	4.1. Банковское регулирование и риск-менеджмент 4.2 Базельское соглашение 1988 года, его недостатки и достоинства 4.3 Соглашение Базель 2 как развитие практики хеджирования рисков в банковской сфере 4.Основные положения соглашения Базель 3.	ПК-1.2.1
5	ПФИ в управлении рисками бизнеса	5. Общая характеристика ПФИ 5. Форвардные и фьючерсные контракты 6. Опционы	ПК-1.2.5
6	Управление процентным риском	7. Цели, задачи и инструменты управления процентным риском 8. Инструменты хеджирования краткосрочных денежных позиций. 8.1 Инструменты хеджирования долгосрочных денежных позиций.	ПК-1.2.1
7	Управление валютным риском	9. Цели, задачи и инструменты управления валютными рисками	ПК-2.1.3

		10. Спот и форвардные валютного рынка; 11. Валютные фьючерсы и валютные опционы 12. Валютные свопы.	
8	Организационно-производственный менеджмент как основа в системе антикризисного управления	8.1 Официальная методика «Порядок анализа причин неплатежеспособности предприятий» 8.2. Критерии выбора методов финансового оздоровления 8.3. Мероприятия по преодолению кризисного состояния предприятия 8.4. Реструктуризация бизнеса 8.5. Оценка бизнеса в системе антикризисного управления 8.6. Методика определения риска, рекомендованная Всемирным Банком	ПК-2.1.3
9	Международный опыт регулирования банкротства и санации предприятий	9.1 Зарубежный опыт антикризисного управления 9.2. Эволюция антикризисной системы США 9.3. Антикризисные системы Германии и Японии	ПК-2.1.3

5.2 Разделы дисциплины и виды занятий

Для очной формы обучения:

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Л	ПЗ	ЛР	СРС
1	Риски в экономике и риск-менеджмент	4	2	-	4
2	Корпоративный риск-менеджмент	4	4	-	4
3	Риск и доходность	4	4	-	4
4	Банковский риск-менеджмент	4	4	-	4
5	Производные финансовые инструменты в управлении рисками бизнеса	4	4	-	4
6	Управление процентным риском	4	4	-	4
7	Управление валютным риском	4	4	-	4
8	Организационно-производственный менеджмент как основа в системе антикризисного управления	2	4	-	2
9	Международный опыт регулирования банкротства и санации бизнеса	2	2	-	2
	Итого	32	32		40

Для очно-заочной формы обучения:

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Л	ПЗ	ЛР	СРС
1	Риски в экономике и риск-менеджмент	2	2	-	8
2	Корпоративный риск-менеджмент	2	2	-	8
3	Риск и доходность	2	2	-	8
4	Банковский риск-менеджмент	2	2	-	8
5	Производные финансовые инструменты в управлении рисками бизнеса	4	2	-	8
6	Управление процентным риском	2	4	-	8
7	Управление валютным риском	-	-	-	8
8	Организационно-производственный менеджмент как основа в системе антикризисного управления	2	2	-	8
9	Международный опыт регулирования банкротства и санации бизнеса	-	-	-	8
Итого		16	16		72

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 /](https://ibooks.ru/) — Режим доступа: для авториз. пользователей;

– Электронная библиотека ЮПАЙТ. – URL: <https://biblio-online.ru/> — Режим доступа: для авторизованных 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" - это научная электронная библиотека, построенная на парадигме открытой науки (OpenScience), основными задачами которой является популяризация науки и научной деятельности, общественный контроль качества научных публикаций, развитие междисциплинарных исследований, современного института научной рецензии и повышение цитируемости российской науки. – 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:

– Баринов, Владимир Александрович. Бизнес-планирование [Электронный ресурс]: Учебное пособие. — 4, перераб. и доп. — Москва; Москва: Издательство "ФОРУМ": ООО

"Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2017. — 272 с.

- Купцова, Е. В. Бизнес-планирование: учебник и практикум для вузов / Е. В. Купцова, А. А. Степанов. — Москва: Издательство Юрайт, 2020. — 435 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-8377-7. — Текст: электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/450359>.

- Лопарева, А. М. Бизнес-планирование: учебник для вузов / А. М. Лопарева. — 3-е изд., перераб. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2020. — 273 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-13541-1. — Текст: электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/465851>

- Моршкин, Виктор Алексеевич. Бизнес-планирование [Электронный ресурс]: Учебное пособие. — 2, перераб. и доп. — Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2018. — 288 с.

- Попадюк, Татьяна Геннадьевна. Бизнес-планирование [Электронный ресурс]: Учебное пособие. — 1. — Москва; Москва: Вузовский учебник: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2017

- Сергеев, А. А. Бизнес-планирование: учебник и практикум для вузов / А. А. Сергеев. — 4-е изд., испр. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2021. — 483 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-13182-6. — Текст: электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/470376>.

- Федеральный закон от 27.12.2002 N 184-ФЗ (ред. от 05.04.2016) "О техническом регулировании". — URL: <http://www.consultant.ru/cons/cgi/online.cgi?req=doc;base=LAW;n=196382#0> — Режим доступа: свободный;

- Федеральный закон "О государственной регистрации юридических лиц и индивидуальных предпринимателей" от 08.08.2001 N 129-ФЗ (последняя редакция). - URL: http://www.consultant.ru/document/cons_doc_LAW_32881/— Режим доступа: свободный;

- Федеральный закон от 26.12.1995 N 208-ФЗ (ред. от 31.07.2020, с изм. от 24.02.2021) "Об акционерных обществах" (с изм. и доп., вступ. в силу с 01.01.2021). - URL: http://www.consultant.ru/document/cons_doc_LAW_8743/ — Режим доступа: свободный.

- Менеджмент в России и за рубежом: Все о теории и практике управления бизнесом, финансами, кадрами. - М.: Финпресс. - ISSN 1028-5857. - Выходит раз в два месяца - Текст;

8.6. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», используемых в образовательном процессе:

-Личный кабинет обучающегося и электронная информационно-образовательная среда. [Электронный ресурс]. – URL:<https://sdo.pgups.ru> — Режим доступа: для авториз. пользователей;

-Министерство экономического развития Российской Федерации [Электронный ресурс]. – URL: <http://www.economy.gov.ru> — Режим доступа: свободный;

- Электронный фонд правовой и нормативно-технической документации – URL: <http://docs.cntd.ru/> — Режим доступа: свободный;

- Федеральная служба государственной статистики [Электронный ресурс]. – URL: <http://www.gks.ru> — Режим доступа: свободный.

Разработчик программы,
Доцент кафедры

А. И. Сорокин

14 января 2025 г.