

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 «Риск-менеджмент в транспортной отрасли»

для направления подготовки 38.03.02 «Менеджмент»

по профилю

«Бизнес-менеджмент»

Форма обучения очная

Санкт-Петербург

2026

ЛИСТ СОГЛАСОВАНИЙ

Рабочая программа рассмотрена и обсуждена на заседании кафедры
«Менеджмент и маркетинг»
Протокол № 6 от 28 января 2026 г.

Зав. кафедрой
«Менеджмент и маркетинг»
28 января 2026 г.

О.В. Ваганова

СОГЛАСОВАНО

Руководитель ОПОП ВО
«Бизнес–менеджмент»
28 января 2026 г.

В.Э. Кроливецкая

1. Цели и задачи дисциплины

Рабочая программа дисциплины «Риск-менеджмент в транспортной отрасли» (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 22.11.2023 № 821н.

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, в том числе транспортной отрасли.

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
<i>ПК-1: «Формирование возможных решений на основе разработанных для них целевых показателей»</i>	
<i>ПК-1.2.1 Умеет выявлять, регистрировать, анализировать и классифицировать риски и разрабатывать комплекс мероприятий по управлению ими</i>	<i>Обучающийся умеет:</i> - анализировать внутренние (внешние) факторы и условия, влияющие на деятельность транспортной организации с целью выявления причин кризиса; - рассчитывать риски инвестиционных проектов на основе существующих методик.
<i>ПК-1.2.5 Умеет анализировать внутренние</i>	<i>Обучающийся умеет:</i> - выявлять и классифицировать риски, связанные с

Индикаторы достижения компетенций	Результаты обучения по дисциплине
<i>(внешние) факторы и условия, влияющие на деятельность организации</i>	<i>особенностями финансово-экономической деятельностью предприятия с целью дальнейшей минимизации рисков на основе использования производных финансовых инструментов.</i>
ПК-3: «Разработка инвестиционного проекта»	
<i>ПК-3.1.3 Знает основные факторы риска, их количественную оценку в рамках реализации инвестиционного проекта</i>	<i>Обучающийся знает: - факторы риска, их количественную оценку в рамках реализации инвестиционного проекта транспортной компании.</i>
<i>ПК-3.2.1 Умеет разрабатывать меры по снижению воздействия основных факторов риска на эффективность проекта</i>	<i>Обучающийся умеет: - разрабатывать меры по снижению воздействия основных факторов риска на эффективность проекта транспортной компании.</i>
ПК-5: «Формирование экспертного заключения о возможности реализации инвестиционного проекта»	
<i>ПК-5.1.3 Знает теорию управления рисками инвестиционного проекта</i>	<i>Обучающийся знает: - теорию управления рисками инвестиционного проекта транспортной компании.</i>
<i>ПК-5.2.2 Умеет выявлять и оценивать степень (уровень) риска инвестиционного проекта</i>	<i>Обучающийся умеет: - оценивать степень (уровень) риска инвестиционного проекта транспортной компании.</i>
<i>ПК-5.2.4 Умеет разрабатывать мероприятия по управлению рисками инвестиционного проекта</i>	<i>Обучающийся умеет: - разрабатывать мероприятия по управлению рисками инвестиционного проекта транспортной компании.</i>

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

Примечание: 3 – зачет

5. Содержание и структура дисциплины

5.1 Содержание дисциплины

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела	Индикаторы достижения компетенций
1	Риски в экономике. Задачи корпоративного риск-менеджмента.	1.1. Понятие риска. 1.2. Управление рисками. 1.3. Соотношение риска и вознаграждения. 1.4. Типологии рисков. 1.5. Задачи риск-менеджмента.	ПК-3.1.3
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-5.1.3 ПК-5.2.2
3	Риск корпоративного кредитования. Рейтинговые агентства.	- Система кредитных рейтингов, ее назначение и цели использования; - процесс присвоения рейтинга внешними агентствами; - кредитный рейтинг эмитента; - кредитный рейтинг эмиссии; кредитные рейтинги ведущих мировых кредитных агентств; - внутренние банковские рейтинги, их назначение; - рейтинг дефолта заемщика и рейтинг потерь в случае дефолта	ПК-5.1.3 ПК-3.1.3. ПК-5.2.2
		-Соотношение риска и доходности;	

4	Риск и доходность как взаимосвязанные понятия	- понятие риска; - диверсифицируемый и не диверсифицируемый (рыночный) риск;	ПК-5.2.2 ПК-5.1.3 ПК-3.1.3.
5	Расчет доходности и риска на основе «сценарного метода».	-освоение методики расчета риска на основе практических расчетов	ПК-5.2.2 ПК-1.2.5 ПК-3.1.3.
6	Расчет доходности и риска на основе методики «Дерево вероятностей»	- освоение методики расчета риска на основе практических расчетов	ПК-1.2.5 ПК-3.1.3.
7	Производные финансовые инструменты (ПФИ) в управлении рисками бизнеса	Общая характеристика рынка ПФИ; - ПФИ как инструменты управления рисками сделок - биржевые и внебиржевые ПФИ.	ПК-5.1.3 ПК-5.2.2 ПК-3.2.1
8	Хеджирование рыночного риска: фьючерсы и форварды и опционы	Фьючерсы и опционы как инструменты хеджирования рыночного риска	ПК-2.1.3 ПК-5.2.2 ПК-3.2.1
9	Хеджирование процентного риска	Хеджирование краткосрочных и долгосрочных денежных позиций с помощью фьючерсов и опционов. Цели, задачи и инструменты управления процентным риском Инструменты хеджирования краткосрочных денежных позиций. Инструменты хеджирования долгосрочных денежных позиций.	ПК-5.2.2 ПК-3.2.1
10	Особенности риск-менеджмента в транспортной отрасли	Риск-менеджмент в транспортной отрасли: - специфика железнодорожных перевозок: риски грузовых перевозок, риски пассажирских перевозок, в т.ч. в высокоскоростном сообщении; - специфика автомобильных перевозок: логистические риски; - риски мультимодальных перевозок.	ПК-1.2.1 ПК-1.2.5

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 задачи риск-менеджмента компании	2	2	-	4
2	Корпоративный риск-менеджмент	4	2	-	4
3	Риск корпоративного кредитования. Рейтинговые агентства	4	2	-	6
4	Риск и доходность как взаимосвязанные понятия	6	2	-	4
5	Расчет доходности и риска ИП на основе «сценарного метода»	2	2	-	4
6	Расчет доходности и риска на основе методики «Дерево вероятностей»	2	2	-	4
7	Производные финансовые инструментами в управлении рисками бизнеса	4	4	-	6
8	Хеджирование рыночного риска с помощью ПФИ	2	2	-	2
9	Хеджирование процентного риска: фьючерсы и опционы	2	2		2
10	Особенности риск-менеджмента в транспортной отрасли	4	4		4
		32	32		40

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. Перечень лицензионных программ представлен на внутреннем портале ФГБОУ ВО ПГУПС по адресу <http://eaisu.pgups.edu.mps/info/prog/>

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 ЮРАЙТ. – 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.

- Владимирова, Т.А. Оценка стратегических операционных рисков транспорта : учебное пособие / Т. А. Владимирова, А. В. Давыдов, В. Г. Соколов, Ю. В. Чепига. — Новосибирск : СГУПС, 2018. — 111 с. — 978-5-93461-980-1. — Текст : электронный // УМЦ ЖДТ : электронная библиотека. — URL: <https://umczdt.ru/books/1308/262337/>

- 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>

- Мамаев, Э.А. Контроллинг и управление логистическими рисками : / Э. А. Мамаев, Л. В. Маколова. — Ростов-на-Дону : РГУПС, 2023. — 90 с. — 978-5-907494-42-8. — Текст : электронный // УМЦ ЖДТ : электронная библиотека. — URL: <https://umczdt.ru/books/1021/288853/>

- Морошкин, 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

- Романова, А.Т. Интеграционные процессы как способ снижения рисков : / А. Т. Романова. — Москва : УМЦ ЖДТ, 2024. — 256 с. — 978-5-907695-51-1. — Текст : электронный // УМЦ ЖДТ : электронная библиотека. — URL: <https://umczdt.ru/books/961/289742/>

- 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

Т.Ю. Зобнина