

**МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**  
**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ АВТОНОМНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ**  
**УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ**  
**«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ ТРАНСПОРТА»**  
**(РУТ (МИИТ))**



Рабочая программа дисциплины (модуля),  
как компонент образовательной программы  
высшего образования - программы бакалавриата  
по направлению подготовки  
38.03.01 Экономика,  
утвержденной первым проректором РУТ (МИИТ)  
Тимониным В.С.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

**Риск-менеджмент транспортно-логистического бизнеса**

Направление подготовки: 38.03.01 Экономика

Направленность (профиль): Экономика транспортного и логистического  
бизнеса

Форма обучения: Заочная

Рабочая программа дисциплины (модуля) в виде  
электронного документа выгружена из единой  
корпоративной информационной системы управления  
университетом и соответствует оригиналу

Простая электронная подпись, выданная РУТ (МИИТ)  
ID подписи: 4329  
Подписал: заведующий кафедрой Шкурина Лидия  
Владимировна  
Дата: 25.05.2022

## 1. Общие сведения о дисциплине (модуле).

Целью освоения учебной дисциплины «Риск-менеджмент транспортно-логистического бизнеса» является формирование у обучающихся компетенций в соответствии с требованиями самостоятельно утвержденного образовательного стандарта высшего образования (СУОС) по направлению подготовки 38.03.01 "Экономика", а также формирование у студентов современных фундаментальных знаний в области управления финансовыми рисками экономических субъектов.

## 2. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю).

Перечень формируемых результатов освоения образовательной программы (компетенций) в результате обучения по дисциплине (модулю):

**ПК-66** - Способен выполнять работу по расчету экономических показателей результатов деятельности организаций, а также по разработке бюджетов (планов);

**ПК-68** - Способен разрабатывать инвестиционные проекты развития транспортного и логистического бизнеса с учетом риск-ориентированного подхода.

Обучение по дисциплине (модулю) предполагает, что по его результатам обучающийся будет:

### **Владеть:**

Навыками хеджирования рисков

### **Знать:**

методы управления рисками при осуществлении инвестиционной и инновационной деятельности

### **Уметь:**

Уметь разрабатывать инвестиционные проекты и программы развития транспортного и логистического бизнеса с учетом риск-ориентированного подхода

## 3. Объем дисциплины (модуля).

### 3.1. Общая трудоемкость дисциплины (модуля).

Общая трудоемкость дисциплины (модуля) составляет 4 з.е. (144 академических часа(ов)).

3.2. Объем дисциплины (модуля) в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении учебных занятий:

Тип учебных занятий	Количество часов	
	Всего	Семестр №5
Контактная работа при проведении учебных занятий (всего):	16	16
В том числе:		
Занятия лекционного типа	8	8
Занятия семинарского типа	8	8

3.3. Объем дисциплины (модуля) в форме самостоятельной работы обучающихся, а также в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении промежуточной аттестации составляет 128 академических часа (ов).

3.4. При обучении по индивидуальному учебному плану, в том числе при ускоренном обучении, объем дисциплины (модуля) может быть реализован полностью в форме самостоятельной работы обучающихся, а также в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении промежуточной аттестации.

#### 4. Содержание дисциплины (модуля).

##### 4.1. Занятия лекционного типа.

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
1	<p>Раздел 1.</p> <p>Понятие и сущность финансовых рисков как объекта риск-менеджмента</p> <p>Риск как экономическая категория. Особенности риска.</p> <p>Различные определения финансового риска. Сущность финансового риска. Объективная и субъективная основа финансового риска. Финансовые риски в внутри финансовой деятельности фирмы. Финансовые риски и внешняя финансовая среда деятельности фирмы.</p> <p>Классификация видов финансовых рисков.</p>
2	<p>Раздел 2</p> <p>Методология риск-менеджмента.</p> <p>Методологические основы управления рисками в экономике. Риск-менеджмент. Стратегия. Тактика.</p> <p>Объект управления. Субъект управления. Функции. Схема управления рисками. Основные этапы процесса управления риском. Концепции управления рисками. Структура службы риск-менеджмента.</p>

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
3	Раздел 4 Методы управления финансовыми рисками. Методы трансформации рисков. Отказ от риска. Снижение вероятности ущерба или предотвращение убытка. Уменьшение размера убытков. Разделение риска (дифференциация и дублирование). Аутсорсинг риска. Методы финансирования рисков.
4	Раздел 5 Хеджирование финансовых рисков с использованием производных финансовых инструментов. Классификация производных финансовых инструментов как методов управления финансовыми рисками: опционы, форварды, фьючерсы, свопы и другие финансово – кредитные деривативы. Сущность и виды хеджирования. Основные виды стратегий хеджирования и биржевая спекуляция.

#### 4.2. Занятия семинарского типа.

##### Практические занятия

№ п/п	Тематика практических занятий/краткое содержание
1	Раздел 2 Методология риск-менеджмента Построение карты рисков
2	Раздел 3 Оценка финансовых рисков. Оценка финансовых рисков компании. Проведение деловой игры на тему "Оценка финансовых рисков компании"

#### 4.3. Самостоятельная работа обучающихся.

№ п/п	Вид самостоятельной работы
1	Раздел 1 самостоятельное изучение и конспектирование отдельных тем учебной литературы, связанных с разделом; подготовка к текущему и промежуточному контролю
2	Раздел 2 самостоятельное изучение и конспектирование отдельных тем учебной литературы, связанных с разделом; подготовка к текущему и промежуточному контролю
3	Раздел 3 самостоятельное изучение и конспектирование отдельных тем учебной литературы, связанных с разделом; подготовка к текущему и промежуточному контролю
4	Раздел 4 самостоятельное изучение и конспектирование отдельных тем учебной литературы, связанных с разделом; подготовка к текущему и промежуточному контролю
5	Раздел 5 самостоятельное изучение и конспектирование отдельных тем учебной литературы, связанных с разделом; подготовка к текущему и промежуточному контролю
6	Подготовка к промежуточной аттестации.

5. Перечень изданий, которые рекомендуется использовать при освоении дисциплины (модуля).

№ п / п	Библиографическое описание	Место доступа
1	<p>Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент : учебник / А. Н. Фомичев. - 10-е изд. - Москва : Дашков и К, 2023. - 366 с. - ISBN 978-5-394-05406-8. - Текст : электронный.</p>	<p>ЭБС Znanium - URL: <a href="https://znanium.com/catalog/product/2084174">https://znanium.com/catalog/product/2084174</a></p>
2	<p>Управление экономическими рисками : [Электронный ресурс] : учебное пособие / А. Н. Никифорова ; рец.: Т. Б. Кувалдина, Н. В. Федотова ; Министерство транспорта Российской Федерации [и др.]. - Электрон.</p>	<p>Сайт библиотеки РОАТ URL: <a href="http://biblioteka.rgotups.ru/jirbis2/index.php?option=com_irbis&amp;view=irbis&amp;Itemid=108&amp;task=set_static_req&amp;sys_code=%20658/H%20627-052815425&amp;bns_string=KATB">http://biblioteka.rgotups.ru/jirbis2/index.php?option=com_irbis&amp;view=irbis&amp;Itemid=108&amp;task=set_static_req&amp;sys_code=%20658/H%20627-052815425&amp;bns_string=KATB</a></p>

	<p>текстовые дан. - М. : РУТ(МИИТ) : РОАТ, 2021. - 1 эл. опт. диск (CD-ROM), 82 с. - ISBN 978-5-7473-1102-2 (в кор.).</p>	
3	<p>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 : электронны й</p>	<p>УМЦ ЖДТ : электронная библиотека. — URL: <a href="https://umczdt.ru/books/1021/288853/">https://umczdt.ru/books/1021/288853/</a></p>
4	<p>Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. —</p>	<p>Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/536005">https://urait.ru/bcode/536005</a></p>

	<p>Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 365 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-3502-8. — Текст : электронный</p>	
5	<p>Владимилова, Т. А. Оценка стратегических операционных рисков транспорта : учебное пособие / Т. А. Владимировва, А. В. Давыдов, В. Г. Соколов, Ю. В. Чепига. — Новосибирск : СГУПС, 2018. — 111 с. — 978-5-93461-980-1. — Текст : электронный</p>	<p>УМЦ ЖДТ : электронная библиотека. — URL: <a href="https://umczdt.ru/books/1308/262337/">https://umczdt.ru/books/1308/262337/</a></p>

6. Перечень современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем, которые могут использоваться при освоении дисциплины (модуля).

[www.consultant.ru](http://www.consultant.ru) Информационно-правовая система  
[www.garant.ru](http://www.garant.ru) Информационно-правовая система  
<https://www.fedstat.ru/>База данных ЕМИСС

7. Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства, необходимого для освоения дисциплины (модуля).

Microsoft Office 2003 и выше для проведения лекций, демонстрации презентаций и ведения интерактивных занятий; для выполнения практических заданий; для самостоятельной работы студентов  
Браузер Internet Explorer 6.0 и выше для выполнения текущего контроля успеваемости; для самостоятельной работы студентов

8. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю).

1 Учебная аудитория должна соответствовать требованиям пожарной безопасности и охраны труда по освещенности, количеству рабочих (посадочных) мест студентов. Для проведения аудиторных лекционных и практических занятий требуется рабочее место преподавателя со стулом, столом, доской, мелом или маркером. Для проведения информационно-коммуникационных (интерактивных занятий - представления презентаций) требуется мультимедийное оборудование (проектор), компьютер.

9. Форма промежуточной аттестации:

Экзамен в 5 семестре.

10. Оценочные материалы.

Оценочные материалы, применяемые при проведении промежуточной аттестации, разрабатываются в соответствии с локальным нормативным актом РУТ (МИИТ).

Авторы:

старший преподаватель кафедры  
«Экономика, финансы и управление  
на транспорте»

Е.Н. Сертакова

Согласовано:

Заведующий кафедрой ЭИФ РОАТ  
Председатель учебно-методической  
комиссии

Л.В. Шкурина

С.Н. Климов