

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



Рабочая программа дисциплины (модуля),
как компонент образовательной программы
базового высшего образования
по направлению подготовки
38.03.02 Менеджмент,
утвержденной первым проректором РУТ (МИИТ)
Тимониным В.С.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Риск-менеджмент транспортных систем

Направление подготовки: 38.03.02 Менеджмент

Направленность (профиль): Процессное управление бизнесом

Форма обучения: Очная

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: 2017
Подписал: заведующий кафедрой Ефимова Ольга
Владимировна
Дата: 08.06.2026

1. Общие сведения о дисциплине (модуле).

Целью освоения учебной дисциплины является знакомство студентов с теорией и методологией риск-менеджмента транспортных систем.

К задачам дисциплины относится формирование у студентов системы знаний и практических умений для использования методов риск-менеджмента на транспорте, приобретение навыков обоснования решений в условиях риска, в т.ч. с использованием программного обеспечения.

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю).

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

ПК-1 - Способен систематизировать информацию о бизнес-процессах, формулировать и обосновывать предложения по их улучшению с учетом возможных рисков.

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

Знать:

- основные понятия теории риска;
- стратегии управления риском;
- основные критерии принятия решений в условиях неопределенности;
- основные критерии принятия решений в условиях риска;
- методические аспекты оценки величины риска

Уметь:

- количественно оценивать величину риска;
- оценивать стоимостную меру риска (VaR);
- количественно оценивать склонность к риску лиц, принимающих решение;
- осуществлять выбор бизнес-альтернативы по критерию MVC и EVC;
- оптимизировать состав бизнес-портфеля по критерию минимума риска

Владеть:

- навыками использования критериев Сэвиджа и Гурвица;
- навыками использования критериев MVC и EVC;
- навыками оценки стоимостной меры риска (VaR);
- навыками построения дерева бизнес-решений;
- навыками использования программного обеспечения для решения задач управления рисками

3. Объем дисциплины (модуля).

3.1. Общая трудоемкость дисциплины (модуля).

Общая трудоемкость дисциплины (модуля) составляет 3 з.е. (108 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 №6
Контактная работа при проведении учебных занятий (всего):	64	64
В том числе:		
Занятия лекционного типа	32	32
Занятия семинарского типа	32	32

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 44 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	Введение в теорию риска Рассматриваемые вопросы: - риск как двумерная величина (рисковая ситуация, величина риска); - классификация ситуаций принятия решений;

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
	<ul style="list-style-type: none"> - причины риска; - стратегии управления риском
2	<p>Количественные характеристики величины риска</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - теоретико-вероятностные характеристики величины риска; - математико-статистические характеристики величины риска; - основные теоретические законы распределения величины риска; - методические аспекты статистической оценки величины риска
3	<p>Свойства статистических характеристик величины риска</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - свойства выборочного среднего; - свойства выборочной дисперсии; - свойства стандартного отклонения; - свойства коэффициента вариации
4	<p>Принятие решений в условиях неопределенности</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - понятие бизнес-альтернативы; - проектирование ситуации неопределенности: матричный подход; - критерий безразличия; - критерий Сэвиджа; - критерии оптимизма и пессимизма (критерий Вальда); - критерий Гурвица
5	<p>Оценка склонности к риску</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - типы отношения лиц, принимающих решение, к риску; - общая аналитическая модель склонности к риску; - графическое моделирование склонности к риску (линии уровня); - понятие безрисковой бизнес-альтернативы; - расчет параметра линий уровня по фактическим данным
6	<p>Выбор бизнес-альтернативы по критерию EVC</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - экономический смысл критерия EVC; - методические аспекты использования критерия EVC; - типовые ситуации выбора бизнес-альтернативы по критерию EVC
7	<p>Выбор бизнес-альтернативы по критерию MVC</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - экономический смысл критерия MVC; - методические аспекты использования критерия MVC; - типовые ситуации выбора бизнес-альтернативы по критерию MVC
8	<p>Методы диссипации риска</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - концептуальная модель диссипации риска; - долевое участие в бизнес-альтернативе (партнерство); - реализация бизнес-альтернатив в рамках контракта; - оценка доходности бизнес-альтернативы в условиях риска; - типовые ситуации диссипации риска
9	<p>Графическое моделирование процесса принятия решения в условиях риска</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - нотации моделирования процесса принятия решения; - методические аспекты построения дерева решений;

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
	- выбор бизнес-альтернативы на основе анализа дерева решений; - оценка ожидаемой ценности дополнительной информации о бизнес-альтернативе
10	Оценка стоимостной меры риска Рассматриваемые вопросы: - понятие стоимостной меры риска (VaR); - параметры стоимостной меры риска; - непараметрические методы оценки стоимостной меры риска; - параметрические методы оценки стоимостной меры риска; - метод Монте-Карло для оценки стоимостной меры риска
11	Управление бизнес-портфелем в условиях риска Рассматриваемые вопросы: - основы портфельной теории Марковица; - критерии оптимизации структуры и состава бизнес-портфеля; - метод множителей Лагранжа для оптимизации структуры бизнес-портфеля; - методические аспекты оптимизации состава бизнес-портфеля в условиях риска
12	Информационное обеспечение управления бизнес-рисками Рассматриваемые вопросы: - национальные стандарты в сфере менеджмента риска; - инструментальные средства поддержки принятия решений в условиях риска; - основные участники рынка ПО для управления рисками

4.2. Занятия семинарского типа.

Практические занятия

№ п/п	Тематика практических занятий/краткое содержание
1	Теоретико-вероятностные характеристики величины риска В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навык расчета теоретико-вероятностных характеристик величины риска, имеющей дискретное или непрерывное распределение
2	Математико-статистические характеристики величины риска В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навык расчета абсолютных и относительных математико-статистических характеристик величины риска на основе выборочных данных
3	Принятие решений в условиях неопределенности: критерий Сэвиджа В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навык выбора бизнес-альтернативы в условиях неопределенности по критерию Сэвиджа
4	Принятие решений в условиях неопределенности: критерий Гурвица В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навык выбора бизнес-альтернативы в условиях неопределенности по критерию Гурвица
5	Оценка склонности к риску В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навыки построения графических моделей склонности к риску (линий уровня) и расчета их параметров по фактическим данным
6	Принятие решений в условиях риска: критерий EVC В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навык выбора бизнес-альтернативы по критерию EVC в случае дискретного или непрерывного распределения величины риска

№ п/п	Тематика практических занятий/краткое содержание
7	Принятие решений в условиях риска: критерий MVC В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навык выбора бизнес-альтернативы по критерию MVC в случае дискретного или непрерывного распределения величины риска
8	Методы диссипации риска В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навыки обоснования управленческих решений по диссипации бизнес-рисков в рамках партнерских или контрактных отношений
9	Графическое моделирование процесса принятия решений В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навык построения дерева решений для анализа и выбора бизнес-альтернативы в условиях риска
10	Непараметрические методы оценки стоимостной меры риска В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навык непараметрической оценки стоимостной меры риска (VaR)
11	Параметрические методы оценки стоимостной меры риска В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навык параметрической оценки стоимостной меры риска (VaR)
12	Оптимизация структуры бизнес-портфеля В результате работы на практическом занятии студенты приобретают навык оптимизации структуры бизнес-портфеля по критерию минимума риска

4.3. Самостоятельная работа обучающихся.

№ п/п	Вид самостоятельной работы
1	Изучение рекомендуемой литературы
2	Подготовка к практическим занятиям
3	Подготовка к промежуточной аттестации.
4	Подготовка к текущему контролю.

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

№ п/п	Библиографическое описание	Место доступа
1	Антонов, Г. Д. Управление рисками организации : учебник / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. — Москва : ИНФРА-М, 2023. — 153 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). — DOI 10.12737/6216. - ISBN 978-5-16-013060-6.	https://znanium.com/catalog/product/1897324 (дата обращения: 03.06.2026). - Текст : электронный.
2	Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. —	https://urait.ru/bcode/450164 (дата обращения: 03.06.2026). - Текст : электронный.

	Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 365 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-3502-8.	
3	Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 485 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12206-0.	https://urait.ru/bcode/450664 (дата обращения: 03.06.2026). - Текст : электронный.

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

Научно-техническая библиотека РУТ (МИИТ): <https://library.miiit.ru/>

Образовательная платформа Юрайт: <https://urait.ru/>

Электронно-библиотечная система Znanium: <https://znanium.com/>

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

Пакет приложений Microsoft Office или аналог

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

Для проведения лекционных занятий необходима аудитория с мультимедиа аппаратурой. Для проведения практических занятий требуется аудитория, оснащенная мультимедиа аппаратурой и ПК с необходимым программным обеспечением и подключением к сети интернет.

9. Форма промежуточной аттестации:

Зачет в 6 семестре.

10. Оценочные материалы.

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

Авторы:

доцент, к.н. кафедры «Экономика,
организация производства и
менеджмент»

В.М. Моргунов

Согласовано:

Заведующий кафедрой ЭОПМ

О.В. Ефимова

Председатель учебно-методической
комиссии

М.В. Ишханян