

ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ  
Кафедра экономики

Рег. № 44 03-59  
« 18 » мая 2017 г.

УТВЕРЖДАЮ:  
Декан Экономического факультета  
С.А. Шелковников



16.05.17

ФГОС 2016 г.  
РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ  
(МОДУЛЯ)

Б1.В.ДВ.6.2

Анализ и управление рисками

38.03.02 Менеджмент

Код и наименование направления подготовки

(где 3-4 цифра соответствуют уровню образования: 01 – подготовка по рабочим профессиям (СПО);  
02- подготовка специалистов среднего звена (СПО); 03 – бакалавриат; 04- магистратура; 05 – специалитет; 06 – аспирантура)

профиль: **Логистика и управление цепями поставок**

основной вид деятельности: организационно-управленческая

дополнительный вид деятельности: информационно-аналитическая

(профиль и виды деятельности)

Курс: 4,5,4

Семестр: 8,9,8

Экономический факультет

очная, заочная, очно-заочная

очная, заочная, очно-заочная

Объем дисциплины (модуля)

| Вид занятий                                 | Объем занятий<br>[зачетных ед./часов] |         |              | Семестр |
|---------------------------------------------|---------------------------------------|---------|--------------|---------|
|                                             | очная                                 | заочная | очно-заочная |         |
| <b>Общая трудоемкость по учебному плану</b> | 3/108                                 | 3/108   | 3/108        | 8,9,8   |
| В том числе,                                |                                       |         |              |         |
| <b>Контактная работа</b>                    | 58                                    | 16      | 32           |         |
| Лекции                                      | 26                                    | 8       | 18           |         |
| Практические (семинарские) занятия          | 32                                    | 8       | 14           |         |
| <b>Самостоятельная работа, всего</b>        | 50                                    | 92      | 76           |         |
| <b>В том числе:</b>                         |                                       |         |              |         |
| Курсовой проект (курсовая работа)           |                                       |         |              |         |
| Контрольная работа / реферат                | К.р.                                  | К.р.    | К.р.         | 8,9,8   |
| Форма контроля                              |                                       |         |              |         |
| Экзамен (зачет)                             | Зачет                                 | Зачет   | Зачет        | 8,9,8   |

Новосибирск 2017

Рабочая программа составлена на основании требований Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования к содержанию и уровню подготовки выпускников по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент (уровень бакалавриата), утвержденного приказом Минобрнауки России от 12.01.2016 г. № 7.

**Программу разработали:**

\_\_\_\_\_

канд. экон. наук

(должность)

\_\_\_\_\_



подпись

\_\_\_\_\_

А.В. Завальнюк

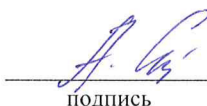
ФИО

\_\_\_\_\_

ст.преподаватель

(должность)

\_\_\_\_\_



подпись

\_\_\_\_\_

А.Ю. Стома

ФИО

## Лист регистрации изменений рабочей программы

[illegible]

# 1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю) соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

## 1.1 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине

В результате изучения дисциплины студент должен:

**знать:** сущность рисков, их источники и факторы возникновения.

**уметь:** классифицировать риски по различным признакам; осуществлять сравнение альтернативных решений в условиях риска; разрабатывать программу по анализу и управлению рисками.

**владеть:** методикой оценки потерь ресурсов и основными методами управления рисками; навыками решения практических задач и тестов в области риск-менеджмента

## 1.2 Планируемые результаты освоения образовательной программы

Дисциплина «Анализ и управление рисками» в соответствии с требованиями ФГОС ВО направлена на формирование следующих компетенций:

1. Общефессиональные компетенции: способностью находить организационно-управленческие решения и готовностью нести за них ответственность с позиций социальной значимости принимаемых решений (ОПК-2).

2. Профессиональные компетенции: умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании (ПК-15).

Таблица 1. Связь результатов обучения с приобретаемыми компетенциями

| № п/п | Результаты освоения дисциплины: знания, умения, навыки                                                                                            | Формируемые компетенции (ОПК, ПК) |
|-------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------|
| 1     | <b>Знать:</b>                                                                                                                                     |                                   |
| 1.1   | Сущность рисков, их источники и факторы возникновения                                                                                             | ОПК-2; ПК-15                      |
| 2.    | <b>Уметь:</b>                                                                                                                                     |                                   |
| 2.1   | Классифицировать риски по различным признакам                                                                                                     | ОПК-2; ПК-15                      |
| 2.2   | Осуществлять сравнение альтернативных решений в условиях риска                                                                                    | ОПК-2; ПК-15                      |
| 2.3   | Разрабатывать программу по анализу и управлению рисками                                                                                           | ОПК-2; ПК-15                      |
| 3     | <b>Владеть:</b>                                                                                                                                   |                                   |
| 3.1   | Методикой оценки потерь ресурсов и основными методами управления рисками; навыками решения практических задач и тестов в области риск-менеджмента | ОПК-2; ПК-15                      |

## 2. Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Дисциплина «Анализ и управление рисками» относится к вариативной части, к дисциплинам по выбору.

Данная дисциплина опирается на курсы дисциплин: экономическая теория; экономика организаций АПК и является основой для последующего изучения дисциплин: инвестиционный анализ, агропромышленная интеграция в масштабах цепей поставок.

## 3. Содержание дисциплины (модуля)

Распределение часов по темам и видам занятий представляется в таблицах 2-4 по каждой форме обучения (очная, заочная, очно-заочная):

Таблица 2. Очная форма

| № п/п | Наименование разделов и тем                                                                    | Количество часов |                      |                             |               | Формируемые компетенции (ОПК, ПК) |
|-------|------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|-----------------------------|---------------|-----------------------------------|
|       |                                                                                                | Лекции (Л)       | Вид занятия (ЛР, ПЗ) | Самостоятельная работа (СР) | Всего по теме |                                   |
|       | Семестр № 8                                                                                    |                  |                      |                             |               |                                   |
|       | Раздел 1. Атрибуты рисков в коммерческой деятельности                                          |                  |                      |                             |               |                                   |
| 1.1.  | Риск и проблемы устойчивости функционирования организации                                      | 4                | 4                    | 4                           | 12            | ОПК-2;<br>ПК-15                   |
| 1.2   | Классификация рисков                                                                           | 4                | 3                    | 4                           | 11            | ОПК-2;<br>ПК-15                   |
|       | Раздел 2. Управление рисками                                                                   |                  |                      |                             |               |                                   |
| 2.1.  | Потери ресурсов при осуществлении предпринимательской деятельности в условиях неопределенности | 3                | 6                    | 4                           | 13            | ОПК-2;<br>ПК-15                   |
| 2.2.  | Анализ системы управления риском                                                               | 4                | 5                    | 4                           | 13            | ОПК-2;<br>ПК-15                   |
| 2.3   | Методы управления рисками                                                                      | 3                | 6                    | 4                           | 13            | ОПК-2;<br>ПК-15                   |
| 2.4.  | Сравнение альтернативных решений в условиях риска                                              | 5                | 6                    | 4                           | 15            | ОПК-2;<br>ПК-15                   |
| 2.5.  | Управление рисками на основе страхования                                                       | 3                | 2                    | 5                           | 10            | ОПК-2;<br>ПК-15                   |
|       | Контрольная работа                                                                             |                  |                      | 12                          | 12            | ОПК-2;<br>ПК-15                   |
|       | Зачет                                                                                          |                  |                      | 9                           | 9             | ОПК-2;<br>ПК-15                   |
|       | <b>Итого:</b>                                                                                  | <b>26</b>        | <b>32</b>            | <b>50</b>                   | <b>108</b>    |                                   |

Таблица 3. Заочная форма

| №<br>п/п | Наименование разделов и тем                                                                    | Количество часов |                      |                             |               | Формируемые компетенции (ОПК, ПК) |
|----------|------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------------------|-----------------------------|---------------|-----------------------------------|
|          |                                                                                                | Лекции (Л)       | Вид занятия (ЛР, ПЗ) | Самостоятельная работа (СР) | Всего по теме |                                   |
|          | Семестр № 9                                                                                    |                  |                      |                             |               |                                   |
|          | Раздел 1. Атрибуты рисков в коммерческой деятельности                                          |                  |                      |                             |               |                                   |
| 1.1.     | Риск и проблемы устойчивости функционирования организации                                      | 2                |                      | 13                          | 15            | ОПК-2;<br>ПК-15                   |
| 1.2.     | Классификация рисков                                                                           |                  |                      | 8                           | 8             | ОПК-2;<br>ПК-15                   |
|          | Раздел 2. Управление рисками                                                                   |                  |                      |                             |               |                                   |
| 2.1.     | Потери ресурсов при осуществлении предпринимательской деятельности в условиях неопределенности | 1                | 2                    | 9                           | 12            | ОПК-2;<br>ПК-15                   |
| 2.2.     | Анализ системы управления риском                                                               | 2                | 1                    | 10                          | 13            | ОПК-2;<br>ПК-15                   |
| 2.3      | Методы управления рисками                                                                      | 1                | 1                    | 10                          | 12            | ОПК-2;<br>ПК-15                   |
| 2.4.     | Сравнение альтернативных решений в условиях риска                                              | 2                | 4                    | 10                          | 16            | ОПК-2;<br>ПК-15                   |
| 2.5.     | Управление рисками на основе страхования                                                       |                  |                      | 10                          | 10            | ОПК-2;<br>ПК-15                   |
|          | Контрольная работа                                                                             |                  |                      | 18                          | 18            | ОПК-2;<br>ПК-15                   |
|          | Зачет                                                                                          |                  |                      | 4                           | 4             | ОПК-2;<br>ПК-15                   |
|          | <b>Итого:</b>                                                                                  | <b>8</b>         | <b>8</b>             | <b>92</b>                   | <b>108</b>    |                                   |

Таблица 4. Очно-заочная форма

| №<br>п/п | Наименование разделов и тем                               | Количество часов |                      |                             |               | Формируемые компетенции (ОПК, ПК) |
|----------|-----------------------------------------------------------|------------------|----------------------|-----------------------------|---------------|-----------------------------------|
|          |                                                           | Лекции (Л)       | Вид занятия (ЛР, ПЗ) | Самостоятельная работа (СР) | Всего по теме |                                   |
|          | Семестр № 8                                               |                  |                      |                             |               |                                   |
|          | Раздел 1. Атрибуты рисков в коммерческой деятельности     |                  |                      |                             |               |                                   |
| 1.1.     | Риск и проблемы устойчивости функционирования организации | 3                | 2                    | 8                           | 13            | ОПК-2;<br>ПК-15                   |
| 1.2.     | Классификация рисков                                      | 2                |                      | 7                           | 9             | ОПК-2;<br>ПК-15                   |
|          | Раздел 2. Управление рисками                              |                  |                      |                             |               |                                   |

|      |                                                                                                |           |           |           |            |                 |
|------|------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|-----------|-----------|------------|-----------------|
| 2.1. | Потери ресурсов при осуществлении предпринимательской деятельности в условиях неопределенности | 2         | 3         | 8         | 13         | ОПК-2;<br>ПК-15 |
| 2.2. | Анализ системы управления риском                                                               | 4         | 2         | 8         | 14         | ОПК-2;<br>ПК-15 |
| 2.3. | Методы управления рисками                                                                      | 2         | 2         | 8         | 12         | ОПК-2;<br>ПК-15 |
| 2.4. | Сравнение альтернативных решений в условиях риска                                              | 4         | 4         | 8         | 16         | ОПК-2;<br>ПК-15 |
| 2.5. | Управление рисками на основе страхования                                                       | 1         | 1         | 8         | 10         | ОПК-2;<br>ПК-15 |
|      | Контрольная работа                                                                             |           |           | 12        | 12         | ОПК-2;<br>ПК-15 |
|      | Зачет                                                                                          |           |           | 9         | 9          | ОПК-2;<br>ПК-15 |
|      | <b>Итого:</b>                                                                                  | <b>18</b> | <b>14</b> | <b>76</b> | <b>108</b> |                 |

Учебная деятельность состоит из аудиторной работы, которая включает лекции, практические занятия, в том числе тесты, задачи; контрольной и самостоятельной работы.

### **3.1.Содержание отдельных разделов и тем**

#### **Раздел 1. Атрибуты рисков в коммерческой деятельности**

##### ***Тема 1.1. Риск и проблемы устойчивости функционирования организации***

Понятие риска. Влияние дестабилизирующих факторов внешней среды на риски организации. Источники и факторы возникновения рисков. Устойчивость среды и устойчивость предприятия. Внутренние и внешние факторы финансовой устойчивости организации.

##### ***Тема 1.2. Классификация рисков***

Классификация и характеристика рисков по различным признакам. Морфологический анализ рисков.

#### **Раздел 2. Управление рисками**

##### ***Тема 2.1. Потери ресурсов при осуществлении предпринимательской деятельности в условиях неопределенности***

Виды и характеристика потерь ресурсов. Зоны риска. Методика определения размера ущерба (убытков).

### ***Тема 2.2. Анализ системы управления риском***

Риск менеджмент. Базовые факторы риск-менеджмента. Международный стандарт ISO 31000 «Риск Менеджмент – Принципы и руководства». Управление риском как система. Анализ и этапы системы управления риском, их характеристика.

### ***Тема 2.3. Методы управления рисками***

Методы управления рисками: уклонение от риска; диссипация риска; диверсификация риска; страхование риска; поглощение риска (принятие риска на себя); трансферт рисков; лимитирование риска.

Их характеристика и условия использования.

### ***Тема 2.4. Сравнение альтернативных решений в условиях риска***

Учет альтернативных решений и отношения к риску при управлении логистическими рисками. Осторожное, склонное к риску и нейтральное отношение к риску лица, принимающего решение. Выбор наилучшего решения в условиях риска на основе дерева решений.

### ***Тема 2.5. Управление рисками на основе страхования***

Сущность и виды страхования. Цели и оптимальные решения в страховании рисков в логистике. Основные характеристики элементов страховых контрактов. Страхование рисков при транспортировке. Страхование грузов.

#### 4. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины (модуля)

##### 4.1. Список основной литературы

1. Антонов, Г. Д. Управление рисками организации: Учебное пособие / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2017. - 153 с.: 60х90 1/16 + ( Доп. мат. znanium.com). - (Высшее образование: Бакалавриат), (ЭБС Инфра-М).

##### 4.2. Список дополнительной литературы

1. Анализ и управление рисками организации: Учебное пособие / Н.А. Рыхтикова. - 2-е изд. - М.: Форум, 2014. - 240 с.: 60х90 1/16. - (Высшее образование). (ЭБС Инфра-М)

2. Воробьев, С. Н. Управление рисками в предпринимательстве [Электронный ресурс] / С. Н. Воробьев, К. В. Балдин. - 4-е изд., испр. - М. : Издательско-торговая корпорация «Дашков и Ко», 2013. - 482 с. - ISBN 978-5-394-01987-6, (ЭБС Инфра-М).

##### 4.3. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

Таблица 5. Перечень информационных ресурсов

| № п/п | Наименование                                                        | Адрес                                                               |
|-------|---------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|
| 1     | Теория риска                                                        | <a href="http://www.risktheory.ra">http://www.risktheory.ra</a>     |
| 2     | Клуб российских риск-менеджеров                                     | <a href="http://www.riskmanager.ra">http://www.riskmanager.ra</a>   |
| 3     | Профессиональный портал для риск-менеджеров                         | <a href="http://www.riskovik.com">http://www.riskovik.com</a>       |
| 4     | Сайт Центра Статистических Исследований (ЦеСИ)                      | <a href="http://www.riskcontrol.ru">http://www.riskcontrol.ru</a>   |
| 5     | Портал о страховании рисков                                         | <a href="http://risk-insurance.ru">http://risk-insurance.ru</a>     |
| 6     | Портал ресурсов по управлению рисками для малого и среднего бизнеса | <a href="http://www.risk-academy.ru">http://www.risk-academy.ru</a> |
| 7     | Российское научное общество анализа риска                           | <a href="http://sra-russia.ru">http://sra-russia.ru</a>             |
| 8     | Свободная энциклопедия Википедия                                    | <a href="http://ru.wikipedia.org">http://ru.wikipedia.org</a>       |

#### 4.4. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля) и самостоятельной работы

1. Анализ и управление рисками: метод. указания / Новосиб. гос. аграр. ун-т, экон. фак.; сост. А.Ю. Стома.- Новосибирск: Изд-во НГАУ, 2017. – 37 с.

2. Анализ и управление рисками: методические указания по выполнению контрольной работы / Новосиб. гос. аграр. ун-т, экон. фак.; сост. А.Ю. Стома.- Новосибирск, 2017. – 13 с.

#### 4.5. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем, наглядных пособий

Таблица 6. Перечень лицензионного программного обеспечения

| № п/п | Наименование                                                                    | Кол-во ключей   | Тип лицензии или правообладатель |
|-------|---------------------------------------------------------------------------------|-----------------|----------------------------------|
| 1     | Microsoft Windows 7 Prof; Microsoft Windows 8, 10; Microsoft Windows Vista Home | 11              | Microsoft                        |
| 2     | Microsoft Office Prof 2003,2007,2016 (Word, Excel, Access, PowerPoint)          | 11              | Microsoft                        |
| 3     | Браузер MozillaFirefox                                                          | 11              | Mozilla Public License           |
| 4     | Файловый менеджер FreeCommander                                                 | 11              | Бесплатная                       |
| 5     | КонсультантПлюс                                                                 | без ограничений | КонсультантПлюс                  |

Таблица 7. Перечень плакатов (по темам), карт, стендов, макетов, презентаций, фильмов и т.д.

| № п/п | Тип         | Наименование                                                                                                                                                                            | Примечание |
|-------|-------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|
| 1     | Презентация | Риск и проблемы устойчивости функционирования организации                                                                                                                               | 10 слайд   |
| 2     | Презентация | Сравнение альтернативных решений в условиях риска                                                                                                                                       | 8 слайдов  |
| 3     | Презентация | Анализ системы управления риском                                                                                                                                                        | 27 слайдов |
| 4     | Документ    | ГОСТ Р ИСО 31000-2010 Менеджмент риска. Принципы и руководство. Электронный текст документа подготовлен ЗАО "Кодекс" и сверен по: официальное издание М.: Стандартинформ, 2012.– 23 с . | 23 с.      |

## 5. Описание материально-технической базы

Таблица 8. Перечень используемых помещений

| № аудитории | Тип аудитории                                                                                                                                                                   | Перечень оборудования                                                                                                      |
|-------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| НК-407      | Учебная аудитория для занятий семинарского типа и групповых консультаций                                                                                                        | Учебная доска, видеопроектор переносной, ноутбук переносной                                                                |
| НК-414      | Учебная аудитория для занятий лекционного типа                                                                                                                                  | Видеопроектор, проекционный экран, доска учебная, ноутбук переносной                                                       |
| НК-415      | «Учебная компьютерная лаборатория»: аудитория для лабораторных, практических занятий, самостоятельной работы, дипломного и курсового проектирования (выполнения курсовых работ) | Видеопроектор, доска учебная, доска интерактивная, ноутбук переносной, 11 персональных компьютеров                         |
| НК-424      | Учебная аудитория для занятий лекционного типа                                                                                                                                  | Видеопроектор, проекционный экран, доска учебная, ноутбук переносной                                                       |
| НК-433      | Лаборатория «Логистика в АПК». Учебная аудитория для занятий семинарского типа, проведения текущего контроля и промежуточной аттестации                                         | Учебная доска, видеопроектор, персональный компьютер                                                                       |
| З-222       | Учебная аудитория для занятий семинарского типа, практических занятий, текущего контроля и промежуточной аттестации, групповых и индивидуальных консультаций                    | Ноутбук, переносной проектор, экран, доска ученическая.                                                                    |
| Д-406       | Учебная аудитория для лабораторно-практических занятий                                                                                                                          | Проектор стационарный Epson EB-X11 - 1 шт.; Ноутбук переносной; экран Lumier Masier Picture настенный рулонный- 1 шт.      |
| А-3         | Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа                                                                                                                       | Видеопроектор, проекционный экран, ноутбук, аудио усиливающая система, микрофоны 2 шт., экран, док-камера, доска маркерная |
| А-4         | Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа                                                                                                                       | Видеопроектор, проекционный экран, ноутбук, аудио усиливающая система, микрофоны 2 шт., экран, док-камера, доска маркерная |

## 6. Используемые интерактивные формы и методы обучения по дисциплине (модулю)

Таблица 9. Активные и интерактивные формы и методы обучения

| №<br>п/п | Тема                                                                                           | Кол-во<br>часов | Вид<br>учебных<br>занятий | Используемые<br>интерактивные<br>образовательные<br>технологии | Формиру<br>емые<br>компетен<br>ции<br>(ОПК,<br>ПК) |
|----------|------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|---------------------------|----------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|
| 1        | Риск и проблемы устойчивости функционирования организации                                      | 4               | Л                         | Лекция-визуализация                                            | ОПК-2;<br>ПК-15                                    |
|          |                                                                                                | 2               | П                         | Анализ конкретных ситуаций                                     |                                                    |
| 2        | Потери ресурсов при осуществлении предпринимательской деятельности в условиях неопределенности | 2               | П                         | Анализ конкретных ситуаций                                     | ОПК-2;<br>ПК-15                                    |
| 3        | Анализ системы управления риском                                                               | 2               | Л                         | Лекция-визуализация                                            | ОПК-2;<br>ПК-15                                    |
| 4        | Сравнение альтернативных решений в условиях риска                                              | 2               | Л                         | Лекция-визуализация                                            | ОПК-2;<br>ПК-15                                    |
|          |                                                                                                | 4               | ПЗ                        | Анализ конкретных ситуаций                                     |                                                    |
| Итого:   |                                                                                                | 18              | х                         | х                                                              | х                                                  |

## 7. Порядок аттестации студентов по дисциплине (модулю)

Для аттестации студентов по дисциплине используется традиционная система оценки знаний. При невыполнении обучающимся заданий по дисциплине и / или наличии пропусков более 50% занятий по дисциплине обучающийся к сдаче зачета не допускается.

«Зачтено» выставляется обучающемуся, который твердо усвоил программный материал, грамотно и по существу, без существенных неточностей отвечает на вопросы, владеет необходимыми навыками и приемами выполнения практических заданий.

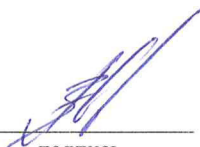
«Не зачтено» выставляется обучающемуся, который не знает значительной части программного материала, допускает принципиальные ошибки, неуверенно, с большими затруднениями выполняет практические задания.

## 8. Согласование рабочей программы

Соответствует учебному плану, утвержденному Ученым советом  
ФГБОУ ВО Новосибирского ГАУ, протокол от «24» 04 2017 г. № 5

Рабочая программа обсуждена и утверждена  
на заседании кафедры  
протокол от «28» 04 2017 г. № 11

Заведующий кафедрой,  
д-р. экон. наук, профессор  
\_\_\_\_\_  
(должность)

  
\_\_\_\_\_  
подпись

Е.В. Рудой  
\_\_\_\_\_  
ФИО

Председатель методической  
комиссии, канд. экон. наук.  
\_\_\_\_\_  
(должность)

  
\_\_\_\_\_  
подпись

И.О. Утешева  
\_\_\_\_\_  
ФИО