

Кафедра менеджменту (№ 602)

ЗАТВЕРДЖУЮ

Голова НМК З

Філіп
(підпис)

Л.О. Філіпковська
(ініціали та прізвище)

« 31 » серпня 2020 р.

**РОБОЧА ПРОГРАМА ВИБІРКОВОЇ
НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ**

Управління ризиками
(назва навчальної дисципліни)

Галузь знань: 07 «Управління та адміністрування»
28 «Публічне управління та адміністрування»
(шифр і найменування галузі знань)

Спеціальність: 073 «Менеджмент»
281 «Публічне управління та адміністрування»
(код і найменування спеціальності)

Освітня програма: «Менеджмент»
«Менеджмент організацій і адміністрування»
(найменування освітньої програми)

Форма навчання: денна

Рівень вищої освіти: перший (бакалаврський)

Харків 2020 рік

Робоча програма _ Управління ризиками

(назва дисципліни)

для студентів за спеціальностями 073 «Менеджмент», 281 «Публічне управління та адміністрування»

освітніми програмами «Менеджмент», «Менеджмент організацій і адміністрування»

« 27 » серпня 2020 р., – 9 с.

Розробник: Бондарєва Т.І., доцент каф.602, к.т.н., доцент

(прізвище та ініціали, посада, науковий ступінь і вчене звання)


(підпис)

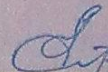
Робочу програму розглянуто на засіданні кафедри менеджменту (№ 602)

(назва кафедри)

Протокол № 1 від « 31 » серпня 2020 р.

Завідувач кафедри д.е.н., професор

(науковий ступінь та вчене звання)


(підпис)

А.В. Доронін

(ініціали та прізвище)

1. Опис навчальної дисципліни

Найменування показників	Галузь знань, спеціальність, освітня програма, рівень вищої освіти	Характеристика навчальної дисципліни (денна форма навчання)
Кількість кредитів –4	Галузь знань <u>07 «Управління та адміністрування»,</u> <u>28 «Публічне управління та адміністрування»</u> (шифр і найменування) Спеціальність <u>073 "Менеджмент"</u> <u>281 «Публічне управління та адміністрування»</u> Освітня програма <u>«Менеджмент»</u> <u>«Менеджмент організацій і адміністрування»</u> Рівень вищої освіти: перший (бакалаврський)	Вибіркова
Кількість модулів – 2		
Кількість змістовних модулів – 2		
Індивідуальне завдання РГР розрахунково-графічна робота на тему: «Аналіз і оцінка ризику підприємства...» (назва)		Навчальний рік
Загальна кількість годин денна форма навчання – – 120 ¹		2020/2021
		Семестр
		8-й
Кількість тижневих годин для денної форми навчання: аудиторних – 2 самостійної роботи студента – 5,5		Лекції*
		30 годин
		Практичні, семінарські*
	24 годин	
	Лабораторні*	
	_____ годин	
	Самостійна робота	
	66 годин	
Вид контролю		
модульний контроль, залік		

Співвідношення кількості годин аудиторних занять до самостійної роботи становить: 54/66

* Аудиторне навантаження може бути зменшене або збільшене на одну годину залежно від розкладу занять.

2. Мета та завдання навчальної дисципліни

Мета: дати знання про технологію управління ризиком у проектах, навчити методам оцінки проектних ризиків, методам визначення втрат при виникненні ризикової події, методам нейтралізації ризиків, оцінки ефективності методів управління ризиком

Завдання: вивчення процесів і методів управління ризиками.

Згідно з вимогами освітньо-професійної програми студенти повинні досягти таких **компетентностей:**

ЗКЗ - Здатність до абстрактного мислення, аналізу, синтезу.

ЗК11 - Здатність до адаптації та дії в новій ситуації.

ФК2 – Здатність аналізувати результати діяльності організації, зіставляти їх з факторами впливу зовнішнього та внутрішнього середовища.

ФК12 – Здатність аналізувати й структурувати проблеми організації, формувати обґрунтовані рішення.

Програмні результати навчання:

ПРН4 – Демонструвати навички виявлення проблем та обґрунтування управлінських рішень.

ПРН6 – Виявляти навички пошуку, збирання та аналізу інформації, розрахунку показників для обґрунтування управлінських рішень.

ПРН11 – Демонструвати навички аналізу ситуації та здійснення комунікації у різних сферах діяльності організації.

ПРН14 – Ідентифікувати причини стресу, адаптувати себе та членів команди до стресової ситуації, знаходити засоби до її нейтралізації.

Міждисциплінарні зв'язки: прийняття управлінських рішень, статистика, управління якістю, стратегічне управління підприємством, управління якістю.

3. Програма навчальної дисципліни

Модуль 1

Змістовний модуль №1. Загальні поняття управління ризиками

ТЕМА 1. Вступна лекція.

Предмет вивчення та задачі дисципліни. Історія виникнення науки про ризики.

ТЕМА 2. Поняття і сутність управління ризиками

Підходи до визначення поняття ризику. Основні кількісні характеристики ризику. Основні види втрат. Основні класифікаційні ознаки ризиків.

ТЕМА 3. Класифікація ризиків

Підходи до класифікації ризиків. Типові ризики: науково-технічний ризик, конструкторський і технологічний ризики, виробничий ризик, транспортний ризик, збутовий ризик, управлінський ризик, фінансовий ризик, політичний ризик, економічний ризик, адміністративний ризик, юридичний ризик, форс-мажор.

ТЕМА 4. Організація процесу управління ризиком на підприємстві

Вплив організаційної структури підприємства на систему управління проектними ризиками. Роль проектного офісу в процесі управління проектними ризиками. Створення підрозділу з управління проектними ризиками. Мета, задачі, структура та принципи створення системи управління ризиками проектів підприємства.

ТЕМА 5. Впровадження системи управління ризиками у діяльність підприємства

Технологія впровадження системи управління ризиками у діяльність підприємства.

Критерії оцінювання ефективності системи управління ризиками підприємства. Витрати на розроблення, впровадження та функціонування системи управління ризиками підприємства.

Модульний контроль

Змістовний модуль №2. Система управління ризиками підприємства

ТЕМА 6. Ідентифікація ризиків

Суть ідентифікації ризиків. Методи ідентифікації ризиків. Причиново-наслідкова діаграма Ішикави.

Причиново-наслідкові зв'язки між подіями, що призводять до виникнення ризиків. Основні причини та наслідки зовнішніх і внутрішніх ризиків.

Приклади ідентифікації ризиків. Ідентифікація зовнішніх ризиків. Ідентифікація внутрішніх ризиків.

ТЕМА 7. Методи аналізу і оцінювання ризиків

Загальна схема аналізу і оцінювання ризиків. Аналіз чутливості проекту. Коефіцієнт еластичності. Матриця чутливості та передбачуваності. Зони ризику.

Статистичні методи оцінювання ризику. Вибір показників ефективності. Оцінювання ефективності та ризику. Правила порівняння та вибору проектів з урахуванням ризику.

Використання «дерева рішень» при аналізі ризиків. Побудова «дерева рішень». Аналіз альтернативних рішень розвитку.

Використання «дерева подій» при аналізі ризиків. Побудова «дерева подій». Оцінювання гіпотез щодо виникнення ризиків при виконанні.

Аналіз рівня негативного впливу ризиків. Шкала оцінювання характеристик ризиків. Побудова таблиць визначення рівня ризиків. Інтегральна оцінка рівня ризиків.

Аналіз сценаріїв розвитку. Метод експертних оцінок. Графоаналітичний метод оцінки ризику. Імітаційне моделювання ризику, метод Монте-Карло.

ТЕМА 8. Методи управління ризиками

Основні методи управління ризиками. Запобігання ризикам або їх зниження. Розподіл ризиків. Самострахування, збереження ризиків. Страхування ризиків. Порівняльний аналіз методів управління ризиками.

Розроблення заходів реагування на ризики. Основні етапи страхування ризиків. Основні етапи самострахування ризиків. Організаційно-технічні заходи щодо зниження, розподілу ризиків.

Оцінювання ефективності методів управління ризиками. Ставка дисконту та чистий зведений дохід проекту. Залишкові втрати. Визначення ставки дисконту проекту з урахуванням прийнятих заходів реагування на проектні ризики. Метод оцінювання ефективності заходів реагування на ризики. Метод вибору заходів реагування на ризики.

Модульний контроль.

Модуль 2

Індивідуальне завдання - розрахунково-графічна робота на тему: «Аналіз і оцінка ризиків підприємства ...»

4. Структура навчальної дисципліни

Назва змістовного модуля і тем	Кількість годин				
	Усього	У тому числі			
		л	п	лаб.	с. р.
1	2	3	4	5	6
Модуль 1					
Змістовний модуль №1. Загальні поняття управління ризиками у проектах					
ТЕМА 1. Вступна лекція.	1	1	-		-
ТЕМА 2. Поняття і сутність управління ризиками	15	4	4		7
ТЕМА 3. Класифікація ризиків	16	5	4		7
ТЕМА 4. Організація процесу управління ризиком на підприємстві	11	2	2		7
ТЕМА 5. Впровадження системи управління ризиками на підприємстві	11	4			7
Модульний контроль	2	2	-	-	-
Разом за змістовним модулем 1	56	18	10		28
Змістовний модуль №2. Система управління ризиками проектів підприємства					
ТЕМА 6. Ідентифікація ризиків	14	2	2		10
ТЕМА 7. Методи аналізу і оцінювання ризиків	22	4	8		10
ТЕМА 8. Методи управління ризиками	14	2	4		8
Модульний контроль	2	2	-	-	-
Разом за змістовним модулем 2	54	12	14		28
Усього годин	110	30	24		56
Модуль 2					
Індивідуальне завдання	10	-	-	-	10
Контрольний захід - залік	-	-	-	-	-
Усього годин	120	30	24	-	66

5. Теми семінарських занять

№ з/п	Назва теми	Кількість годин
1		
2		

6. Теми практичних занять

№ з/п	Назва теми	Кількість годин
1.	Аналіз підходів різних авторів до визначення поняття ризику та класифікації	8
2.	Організаційні аспекти ризик-менеджменту підприємства	2
3.	Ідентифікація ризиків	2
4.	Аналіз чутливості проекту	2
5.	Статистичні методи оцінки ризику	2
6.	Оцінка ризику за допомогою «дерева рішень» і «дерева подій»	2
7.	Аналіз сценаріїв розвитку	2
8.	Розробка плану управління ризиками	4
	Разом	24

7. Теми лабораторних занять

№ з/п	Назва теми	Кількість годин
1		
	Разом	

8. Самостійна робота

№ п/п	Назва теми	Кількість годин
1	Огляд існуючих підходів до визначення поняття ризику (тема 1)	7
2	Огляд існуючих класифікацій ризиків (тема 2)	7
3	Експертні методи у ризик-менеджменті (тема 3)	7
4	Використання теорії прийняття рішень в управлінні ризиками проектів (тема 4)	7
5	Використання теорії ігор для моделювання ризикових ситуацій (тема 5)	10
6	Огляд правил теорії імовірності, законів розподілу імовірної величини, розрахунку її характеристик (тема 6)	10
7	Традиційні прийоми формування премій за ризик (тема 7)	8
8	ІНДЗ – РГР	10
	Разом	66

9. Індивідуальні завдання

Виконання розрахунково-графічної роботи на тему «Аналіз і оцінка ризиків підприємства ...»

10. Методи навчання

Словесні (пояснення, розповідь, бесіда, навчальна дискусія та ін.); наочні (ілюстрування, демонстрування) та практичні (практичні роботи, індивідуальне опитування, тестування).

11. Методи контролю

Контроль і оцінювання якості набутих знань, умінь та практичних навичок студентів має системний характер, базується на принципі наскрізного контролю, який дозволяє забезпечити взаємозв'язок між усіма видами навчального процесу: лекції, практичні, самостійна та індивідуальна робота студента, поточний контроль, залік.

Оцінювання знань студентів здійснюється на основі результатів поточного контролю, письмового модульного контролю, підсумкового контролю у вигляді заліку.

12. Критерії оцінювання та розподіл балів, які отримують студенти

12.1. Розподіл балів, які отримують студенти (кількісні критерії оцінювання)

Складові навчальної роботи	Бали за одне заняття (завдання)	Кількість занять (завдань)	Сумарна кількість балів
Змістовний модуль 1			
Виконання і захист практичних робіт	0...5	4	0...20
Модульний контроль	0...25	1	0...25
Змістовний модуль 2			
Виконання і захист практичних робіт	0...5	4	0...20
Модульний контроль	0...25	1	0...25
Виконання і захист РГР	0...10	1	0...10
Усього за семестр			0...100

Семестровий контроль (залік) проводиться у разі відмови студента від балів поточного тестування й за наявності допуску до іспиту. Під час складання семестрового заліку студент має можливість отримати максимум 100 балів.

12.2. Якісні критерії оцінювання

Необхідний обсяг знань для одержання позитивної оцінки:

- основні класифікаційні ознаки ризиків;
- типові ризики;
- кількісні характеристики ризиків;
- класифікацію втрат під час виникнення ризиків;
- процеси і методи управління ризиком;
- методи якісного та кількісного аналізу ризиків;
- способи визначення ефективності методів управління ризиком.

12.3 Критерії оцінювання роботи студента протягом семестру

Задовільно (60-74). Мати мінімум знань та умінь. Відпрацювати та захистити всі практичні роботи та розрахунково-графічну роботу.

Добре (75 - 89). Твердо знати мінімум знань, виконати усі завдання. Показати вміння виконувати та захищати всі практичні роботи в обумовлений викладачем строк з обґрунтуванням рішень та заходів, які запропоновано у роботах.

Відмінно (90 - 100). Здати всі контрольні точки з оцінкою «відмінно». Досконально знати всі теми та уміти застосовувати одержанні знання.

Шкала оцінювання: бальна і традиційна

Сума балів	Оцінка за традиційною шкалою	
	Іспит, диференційований залік	Залік
90 – 100	Відмінно	Зараховано
75 – 89	Добре	
60 – 74	Задовільно	
0 – 59	Незадовільно	Не зараховано

12. Методичне забезпечення

1. Кількісне оцінювання ризиків [Текст] : навч. посіб. до практ. занять / Т. І. Бондарєва, В. М. Красніков. – Харків: Нац. аерокосм. ун-т ім. М. Є. Жуковського «Харків. авіац. ін-т», 2020. – 48 с.

2. Красніков В. М., Бондарєва Т. І., Романенков Ю. О. Аналіз та оцінка ризиків у підприємницькій діяльності: Навч. посібник. – Харків: Нац. аерокосм. ун-т "Харк. авіац. ін-т", 2006. – 32 с.

3. Навчально-методичне забезпечення дисципліни "Управління ризиками " для бакалаврів / Нац. аерокосм. ун-т ім. М. Є. Жуковського "Харків. авіац. ін-т" ; розроб. Т. І. Бондарєва. - Харків, 2020. - 55с. - режим доступу - http://library.khai.edu/library/fulltexts/2021/complex/MZ_B_073_Upravlinnya%20ryzykamy.pdf, що містить: конспект лекцій, методичні вказівки до виконання розрахунково-графічної роботи, завдання для самостійної роботи, тести для закріплення знань, рекомендована література

14. Рекомендована література

Базова.

1. Вітлінський В.В. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком: Навч.-методич. посібник для самостійного вивч. дисц. / В.В. Вітлінський, П.І. Верченко. – К.: КНЕУ, 2000. – 292 с.
2. Донець Л.І. Економічний ризик і методи його вимірювання / Л.І. Донець. – К.: Центр навчальної літератури, 2006. – 312 с.
3. Хохлов Н.В. Управление риском. Учеб. пособие. – М.: ЮНИТИ, 2001. – 239 с.
3. Машина Н.І. Економічний ризик і методи його вимірювання: навч. посіб. / Н.І. Машина. – К.: Центр навч. л-ри, 2003. – 188 с.
4. Customs risk, laws and regulations, available at:
<http://www.licasoft.com.ua/index.php/component/lica/?href=0&view=text&base=24&id=12856&menu=12919>
5. Клименко С. М. Обґрунтування господарських рішень та оцінка ризиків: [навч. посіб.] / С.М. Клименко, О.С. Дуброва — К.: КНЕУ, 2005. – 252 с.

Допоміжна

1. Вентцель Е.С., Овчаров Л.А. Теория вероятностей и ее инженерные приложения. – М.: Наука, 1988. – 480 с.
2. Риск-менеджмент инвестиционного проекта : учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / [под ред. М.В. Грачевой, А.Б. Секерина]. – М.: Юнити-Дана, 2009. – 544 с.
3. Тэпман Л.Н. Риски в экономике: Учеб. пособие для вузов / Под ред. проф. В.А.Швандара. – М.: Юнити-Дана, 2002. – 380 с.
4. Уткин Э.А. Риск-менеджмент : Учеб. / Э. А. Уткин и др. – М.: Тандем, 1998. – 288 с.
5. Эриашвили Н.Д. Управление рисками в условиях финансового кризиса: учебное пособие / Н.Д. Эриашвили, Л.Н. Тепман. – М.: Юнити-Дана, 2012. – 295 с.
6. Альгин А.П. Грани экономического риска / А.П. Альгин – М.:Знание, 1991. – 340 с.
7. Дубров А.М. Моделирование рискованных ситуаций в экономике и бизнесе: учеб. пособие / А.М. Дубров, Б.А. Лагоша. – М.: Финансы и статистика, 2001. – 224 с.
8. Клебанова Т.С. Теория экономического риска: учеб.-метод. пособие для самостоятельного изучения дисциплины / Т.С. Клебанова, Е.В. Раевнева. – Х.: Изд. дом «ИНЖЭК», 2003. – 156 с.
9. Тэпман Л.Н. Риски в экономике: учеб. пособие для вузов / Л.Н. Тэпман; под ред. проф. В.А. Швандара. – М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2002. – 380 с.
10. Балабанов И.Т. Риск-менеджмент / И.Т. Балабанов. – М.: Финансы и статистика, 1996. – 156 с.