

Міністерство освіти і науки України
Національний аерокосмічний університет ім. М. Є. Жуковського
«Харківський авіаційний інститут»

Кафедра менеджменту (№ 602)

ЗАТВЕРДЖУЮ

Керівник проектної групи



(підпис)

О.М. Калініна

(ініціали та прізвище)

«____» _____ 2019 р.

**РОБОЧА ПРОГРАМА ВИБІРКОВОЇ
НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ**

Управління ризиками у ЗЕД
(назва навчальної дисципліни)

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

Спеціальність: 073 «Менеджмент»
(код і найменування спеціальності)

Освітня програма: «Менеджмент ЗЕД»
(найменування освітньої програми)

Форма навчання: денна

Рівень вищої освіти: перший (бакалаврський)

Харків 2019 рік

Робоча програма Управління ризиками у ЗЕД
(назва дисципліни)
для студентів за спеціальністю 073 «Менеджмент»
освітньою програмою «Менеджмент ЗЕД»

«_27_» __серпня_ 2019 р., – 9 с.

Розробник: Бондарєва Т.І., к.т.н., доцент
(прізвище та ініціали, посада, науковий ступінь і вчене звання)


(підпис)

Робочу програму розглянуто на засіданні кафедри менеджменту
(назва кафедри)

Протокол № _1_ від «_30_» __серпня_ 2019 р.

Завідувач кафедри д.е.н., професор
(науковий ступінь і вчене звання)



А.В. Доронін
(ініціали та прізвище)

1. Опис навчальної дисципліни

Найменування показників	Галузь знань, напрям підготовки (спеціальність, спеціалізація), рівень вищої освіти	Характеристика навчальної дисципліни (денна форма навчання)
Кількість кредитів – 4	Галузь знань <u>07 «Управління та адміністрування»</u> (шифр і найменування) Спеціальність <u>073 "Менеджмент"</u> (код і найменування) Освітня програма <u>«Менеджмент ЗЕД».</u> (найменування) Рівень вищої освіти: Перший (бакалаврський)	Цикл професійної підготовки
Кількість модулів – 2		Навчальний рік 2019/2020 Семестр 8-й Лекцій* 24 годин
Кількість змістових модулів – 2		
Індивідуальне завдання - розрахунково-графічна робота на тему: «Аналіз і оцінка проектного ризику» (назва)		
Загальна кількість годин денна форма навчання – 120 ¹		
Кількість тижневих годин для денної форми навчання: аудиторних – 2 самостійної роботи студента – 5,5		Практичні, семінарські* 30 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 ЗЕД, навчити методам оцінки зовнішньоекономічних ризиків, методам визначення втрат при виникненні ризикової події, методам нейтралізації ризиків, оцінки ефективності методів управління ризиком.

Завдання - вивчення процесів і методів управління ризиками у ЗЕД.

У результаті вивчення навчальної дисципліни студент повинен

знати:

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

повинен вміти:

- проводити класифікацію зовнішньоекономічних ризиків;
- оцінювати втрати при виникненні ризиків;
- організовувати процеси управління ризиком у ЗЕД;
- обирати методи управління ризиком;
- розробляти заходи нейтралізації ризиків;
- проводити ідентифікацію зовнішньоекономічних ризиків;
- проводити кількісний аналіз зовнішньоекономічних ризиків.

мати уявлення про:

- правила теорії імовірності;
- інформаційні технології в галузі управлінні ризиками.

3. Програма навчальної дисципліни

Модуль 1

Змістовний модуль №1. Загальні поняття управління ризиками у ЗЕД

ТЕМА 1. Вступна лекція.

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

ТЕМА 2. Поняття і сутність управління ризиками у ЗЕД

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

Поняття ризику в ЗЕД. Типові ризики ЗЕД: ризик учасників, 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.

Суть управління ризиками. Процеси управління ризиками. Існуючі системи управління ризиками підприємств. Підходи до організації управління ризиками на підприємстві.

ТЕМА 3. Організація процесу управління ризиком на підприємстві – суб'єкті ЗЕД

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

Склад і послідовність побудови моделей системи управління ризиками підприємства. Моделі типового підрозділу управління ризиками підприємства. Цільова, функціональна, структурна й процесна моделі підрозділу управління ризиками підприємства. Матричні проекції між моделями підрозділу управління ризиками підприємства.

ТЕМА 4. Впровадження системи управління ризиками у діяльність підприємства – суб'єкту ЗЕД

Технологія впровадження системи управління ризиками у діяльність підприємства.

Метод адаптації системи управління ризиками до одночасно виконуваних підприємством проектів. Метод адаптації системи управління ризиками підприємства до прийнятих заходів реагування на ризики.

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

Модульний контроль

Змістовний модуль №2. Система управління ризиками підприємства – суб'єкта ЗЕД

ТЕМА 5. 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. Ідентифікація ризиків перевищення тривалості, вартості, низької якості виконання робіт проекту.

ТЕМА 6. Системне подання ризиків підприємства

Принципи управління ризиками підприємства. Метод структурування ризиків підприємства. Склад і послідовність побудови моделей ризиків підприємства.

Моделі подання ризиків підприємства. Модель структури ризиків. Модель причин і наслідків ризиків. Модель характеристик ризиків. Модель рівня ризиків. Модель реагування на ризики. Матричні проекції між моделями ризиків підприємства.

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 проекту. Оцінювання ефективності та ризику проекту. Правила порівняння та вибору проектів з урахуванням ризику.

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

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

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 проектного ризику»

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 у ЗЕД	18	4	5		9
ТЕМА 3. Організація процесу управління ризиком на підприємстві – суб'єкті ЗЕД	16	2	5		9
ТЕМА 4. Впровадження системи управління ризиками проектів у діяльність підприємства – суб'єкта ЗЕД	18	3	5		10
Модульний контроль	2	2	-	-	-
Разом за змістовним модулем 1	55	12	15		28
Змістовний модуль №2. Система управління ризиками проектів підприємства					
ТЕМА 5. Ідентифікація зовнішньоекономічних ризиків	12	2	3		7
ТЕМА 6. Системне подання ризиків проектів підприємства – суб'єкта ЗЕД	13	2	4		7
ТЕМА 7. Методи аналізу і оцінювання ризиків	15	4	4		7
ТЕМА 8. Методи управління ризиками	13	2	4		7
Модульний контроль	2	2	-	-	-
Разом за змістовним модулем 2	55	12	15		28
Усього годин	110	24	30		56
Модуль 2					
Індивідуальне завдання	10	-	-	-	10
Усього годин	120	24	30		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 та класифікації поняття ризику	5
2	Ідентифікація ризиків	5
3	Аналіз чутливості проекту	5
4	Статистичні методи оцінки ризику	3
5	Оцінка ризику за допомогою «дерева рішень» і «дерева подій»	4
6	Аналіз сценаріїв розвитку	4
7	Розробка плану управління ризиками	4
	Разом	30

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)	9
2	Огляд існуючих класифікацій ризиків (тема 2)	9
3	Експертні методи у ризик-менеджменті (тема 3)	10
4	Використання теорії прийняття рішень в управлінні ризиками (тема 4)	7
5	Використання теорії ігор для моделювання ризикових ситуацій (тема 5)	7
6	Огляд правил теорії імовірності, законів розподілу імовірної величини, розрахунку її характеристик (тема 6)	7
7	Традиційні прийоми формування премій за ризик (тема 7)	7
8	ІНДЗ – розрахункова робота	10
	Разом	66

9. Індивідуальні завдання

№ з/п	Назва теми
1	Виконання розрахунково-графічної роботи на тему «Аналіз і оцінка проектного ризику»

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	3...5	4	12...20
Модульний контроль	15...25	1	15...25
Змістовний модуль 2			
Виконання і захист практичних робіт	3...5	4	12...20
Модульний контроль	15...25	1	15...25
Виконання і захист РГР	6...10	1	6...10
Усього за семестр			60...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 ЗЕД;
- кількісні характеристики ризиків;
- класифікацію втрат під час виникнення ризиків;
- процеси і методи управління ризиком у ЗЕД;
- 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 одержані 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. Латкін М.О., Мелешенко С.Ю., Бондарева Т.І. Управління ризиками в проектах: Навч. посібник з практикуму. – Харків: Нац. аерокосм. ун-т "Харк. авіац. ін-т", 2007. – 45 с.

2. Красніков В.М., Бондарева 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.

Література

Основна література.

1. Бушуєв С.Д. Керівництво з питань проектного менеджменту. – К.: Українська асоціація управління проектами, 1999. – 197 с.

2. Верба В.А., Загородніх О.А. Проектний аналіз. Підручник. – К.: КНЕУ, 2000. – 322 с.

3. Хохлов Н.В. Управление риском. Учеб. пособие. – М.: ЮНИТИ, 2001. – 239 с.

4. Кобиляцький Л.С. Управління проектами. Навч. посіб. – К.: МАУП, 2002. – 200 с.

5. Арчибальд Р. Управление высокотехнологичными программами и проектами: пер. с англ. / Р. Арчибальд. – М.: ДМК "Пресс", 2002. – 464 с.

6. Балабанов И.Т. Риск-менеджмент / И.Т. Балабанов. – М.: Финансы и статистика, 1996. – 156 с.

Додаткова література.

1. Щукін Б.М. Аналіз інвестиційних проєктів. – К.: МАУП, 2002.
2. Вентцель Е.С., Овчаров Л.А. Теория вероятностей и ее инженерные приложения. – М.: Наука, 1988. – 480 с.
3. Бланк И.А. Финансовый менеджмент. Учеб. курс. – К.: Ника-Центр, Эльга, 2001. – 528 с.
4. Прыкин Б.В. Техничко-економический анализ производства. Учебник. – М.: ЮНИТИ, 2000. – 399 с.
5. Дубров А.М. Моделирование рисковх ситуаций в экономике и бизнесе: учеб. пособие / А.М. Дубров, Б.А. Лагоша. – М.: Финансы и статистика, 2001. – 224 с.
6. Клебанова Т.С. Теория економического риска: учеб.-метод. пособие для самостоятельного изучения дисциплины / Т.С. Клебанова, Е.В. Раевнева. – Х.: Изд. дом «ИНЖЭК», 2003. – 156 с.
7. Машина Н.І. Економічний ризик і методи його вимірювання: навч. посіб. / Н.І. Машина. – К.: Центр навч. л-ри, 2003. – 188 с.
8. 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.
9. Тянь Р.Б. Управління проєктами: підруч. / Р.Б. Тянь, Б.І. Холод, В.А. Ткаченко. – К.: Центр навч. л-ри, 2003. – 224 с.