

**МІНІСТЕРСТВО ВНУТРІШНІХ СПРАВ УКРАЇНИ
ХАРКІВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ВНУТРІШНІХ СПРАВ
КРЕМЕНЧУЦЬКИЙ ЛЬОТНИЙ КОЛЕДЖ**

Циклова комісія економіки та управління

ПРОГРАМА

**навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент»
обов'язкових компонент
освітньої програми першого (бакалаврського) рівня вищої освіти
073 Менеджмент (Логістика)**

м. Харків 2022

ЗАТВЕРДЖЕНО

Науково-методичною радою
Харківського національного
університету внутрішніх справ
Протокол від 30.08.2022 № 8

СХВАЛЕНО

Методичною радою
Кременчуцького льотного
коледжу
Протокол від 22.08.2022 № 1

ПОГОДЖЕНО

Секцією науково-методичної ради
ХНУВС з гуманітарних та соціально-
економічних дисциплін
Протокол від 29.08.2022 № 8

Розглянуто на засіданні циклової комісії економіки та управління,
протокол від 15.08.2022 № 1

Розробники: викладач циклової комісії економіки та управління, к.е.н.,
спеціаліст вищої категорії, викладач – методист, Пушкар О.І.

Рецензенти:

1. Професор кафедри логістики НАУ, доктор економічних наук, професор, експерт Українського логістичного альянсу (УЛА) Смерічевська С.В.
2. Викладач циклової комісії економіки та управління КЛК ХНУВС, к.е.н., старший викладач Цимбалістова О.А.

ПОЯСНЮВАЛЬНА ЗАПИСКА

Програма вивчення нормативної навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент» складена відповідно до освітньої програми першого (бакалаврського) рівня вищої освіти 073 Менеджмент (Логістика).

Навчальна дисципліна «Ризик-менеджмент» – це одна із нормативних професійно-орієнтованих дисциплін підготовки бакалаврів за освітньо-професійною програмою «Логістика».

Об’єкт і предмет дисципліни: у процесі вивчення навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент» здобувачі набувають теоретичних знань з визначення та класифікації ризиків, управління ризиками та їх запобігання; засвоюють термінологію, основні поняття та методику, що використовуються в міжнародній практиці при розробці систем ризик-менеджменту в організаціях; оволодівають навичками визначення та управління ризиками в логістичних системах. Предмет дисципліни – принципи, методи та форми управління ризиками підприємства.

Міждисциплінарні зв’язки: актуальність вивчення курсу «Ризик-менеджмент» в програмі підготовки фахівців у сфері менеджменту і, зокрема, логістики викликана необхідністю обов’язкової оцінки ризику в будь-якому виді діяльності, перед прийняттям тих чи інших менеджерських рішень. Це особливо важливо в ситуації соціально-економічних і трансформаційних процесів, в яких розвивається сучасна українська економічна система і які супроводжуються невизначеністю, конфліктністю, мінливістю цілей, зумовленими різноманітними причинами, зокрема, природними явищами, політичними подіями, податковим регулюванням, змінами в законодавстві, коливанням цін і курсів валют, конкуренцією, виконанням договірних зобов’язань та рядом інших чинників.

Вивчення навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент» ґрунтується на знаннях та уміннях, які були здобути під час вивчення таких навчальних дисциплін, як «Статистика», «Основи менеджменту», «Маркетинг», «Економіка підприємства», «Логістика та логістичні технології на транспорті», «Операційний менеджмент», «Стратегічний менеджмент»; забезпечує базу для засвоєння матеріалу з навчальних дисциплін «Управління логістичними проектами», «Логістичний контролінг», «Транспортна логістика».

Програма навчальної дисципліни складається з таких тем:

1. Сутність та системні характеристики ризику.
2. Аналіз і оцінка ризиків.
3. Сутність управління ризиками. Методи ризик-менеджменту.
4. Страхування ризиків.

5. Етапи реалізації програми ризик-менеджменту на підприємстві.
6. Операційний ризик-менеджмент.
7. Міжнародні стандарти у процесі управління ризиками суб'єктів господарювання.

1. Мета та завдання навчальної дисципліни

1.1. Метою викладання навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент» є формування системи знань про предмет і суть ризик-менеджменту, його місце в діяльності підприємств в цілому та в різних його підрозділах, ознайомлення майбутніх фахівців з логістики з новими підходами до аналізу, оцінювання та моделювання ризиків та управління ними під час прийняття рішень в логістичних системах.

1.2. Цільова спрямованість курсу обумовлює постановку та вирішення наступних завдань:

- навчити здобувачів ідентифікувати різноманітні небезпеки, оцінювати конкретні ризики, аналізувати і прогнозувати розвиток небезпечних ситуацій, що виникають при здійсненні підприємницької діяльності;
- забезпечити вміння оцінювати ризики, які виникають при здійсненні економічної діяльності, а також розробляти рекомендації щодо ефективних заходів керування ризиком;
- ознайомити здобувачів із основними методиками аналізу соціально - політичних та адміністративно-законодавчих ризиків;
- навчити ідентифікувати різні види виробничих ризиків та оцінювати їх вплив на ефективність ведення зовнішньоекономічної діяльності;
- ознайомити здобувачів із маркетинговими, інноваційними, галузевими ризиками та навчити використовувати сучасні методики їх аналізу;
- забезпечити у студентів навички з оцінки транспортних ризиків та основних методів їх запобігання.

1.3. Згідно з вимогами освітньої програми здобувачі повинні:

знати:

- сутність ризиків, їх види та процес ризик-менеджменту;
- концептуальні засади, цілі і завдання використання методів і технологій управління ризиками;
- фактори, причини та джерела виникнення ризиків;
- принципи ризик-менеджменту;
- методи оцінки ризику, визначати наслідки та ймовірності їх настання у майбутньому, встановлення факторів, що визначають ризик та елементи процесу ризик-менеджменту;

уміти:

- ідентифікувати ризики підприємства, визначати їх причини та джерела визначення;
- оцінювати ризики діяльності підприємства, використовуючи різні методи;
- ефективно управляти ризиками, вибирати методи для оптимізації ризиків;
- формувати програму управління ризиками підприємств, скласти стратегічну карту ризиків.

2. Короткий опис змісту навчальної дисципліни

Тема 1. Сутність та системні характеристики ризику

Основні поняття ризик-менеджменту. Основні компоненти ризику: поняття, функції, причини і фактори виникнення ризиків. Невизначеність та ризик. Класифікація ризиків. Основні види підприємницьких ризиків: ризики підприємства, транспортні ризики. Ідентифікація ризиків в логістичних ланцюгах.

Тема 2. Аналіз і оцінка ризиків

Принципи та послідовність проведення аналізу ризиків. Методи аналізу ризиків: загальна характеристика методів оцінки ризиків, статистичний метод оцінки ризиків; метод аналізу доцільності витрат; метод експертних оцінок; аналітичний метод оцінки ризиків; метод використання аналогів; метод аналізу ризику за допомогою дерева рішень; комплексна оцінка ризиків. Стрес-тестінг компанії.

Тема 3. Сутність управління ризиками. Методи ризик-менеджменту

Сутність управління ризиками. Система ризик-менеджменту. Методи управління ризиками та їх вибір. Особливості управління ризиками підприємства. Ризик та психологічна теорія рішень. Особливості управління логістичними ризиками. Розвиток організаційної структури управління ризиками компанії.

Тема 4. Страхування ризиків

Основні поняття, види та методи страхування. Характеристика страхового ринку. Основні види страхування. Страхування в логістичних системах.

Тема 5. Етапи реалізації програми ризик-менеджменту на підприємстві

Відповідальність менеджменту за управління ризиком. Комплексний ризик-менеджмент. Елементи процесу ризик-менеджменту.

Тема 6. Операційний ризик-менеджмент

Особливості виявлення операційних ризиків. Особливості оцінки ймовірності операційних ризиків.

Тема 7. Міжнародні стандарти у процесі управління ризиками суб'єктів господарювання

Характеристика світових стандартів ризик-менеджменту. Призначення та основні положення міжнародних стандартів ризик-менеджменту ISO 31000:2018 «Ризик-менеджмент» (Risk management – Guidelines), COSO ERM «Управління ризиками організацій. Інтегрована модель», FERMA «Управління ризиками Федерації європейських асоціацій ризик-менеджменту». Впровадження міжнародних стандартів на вітчизняних підприємствах.

3. Рекомендована література (основна, допоміжна), інформаційні ресурси в Інтернеті

Основна література:

1. Старостіна А.О., Кравченко В.А. Ризик-менеджмент: теорія та практика: Навч. посіб. – К.: ІВЦ «Видавництво «Політехніка», 2004. – 200 с.
2. Мамчин М.М., Мних О.Б., Паробецька І.М. Управління ризиками в логістиці: конспект лекцій. – Львів: Видавництво Національного університету «Львівська політехніка», 2009. – 153 с.
3. Логістика невиробничої сфери: Управління ризиками в логістиці : навчальний посібник / Л. О. Мажник, В. О. Письмак. – Харків : ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2016. – 164 с.
4. Донець Л. І., Шепеленко О. В., Баранцева С. М., Сергєєва О. В., Веремейчик О. Ф. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання ризиків. Навчальний посібник / За заг. ред. Донець Л. І. – К.: Центр учбової літератури, 2012. – 472 с.

Допоміжна література:

1. Фисун В. І., Ярова Г. М. Страхування. Навч. посіб. – К.: Центр учбової літератури, 2011. – 232 с.
2. Кучеренко В.Р., Карпов В.А., Карпов А.В. Економічний ризик та методи його вимірювання: Навчальний посібник. – Одеса, 2011. – 199 с.

Інформаційні ресурси в Інтернеті

1. Офіційний веб - портал Верховної Ради України. Режим доступу: <http://zakon3.rada.gov.ua/laws/main/a#Find>

2. Міжнародний Інститут Дослідження Ризиків [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <http://www.miiir.ru/>.
3. Quantum – Finance in Perspective. Сайт , присвячений кількісним методам ризик – менеджменту [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <http://www.quantummagazine.com/>.
4. Офіційний сайт Державна служба статистики України [Електронний ресурс] / Режим доступу: <http://www.ukrstat.gov.ua>
5. Компаньйон online [Электронный ресурс] / Режим доступу:<http://www.companion.ua/>

4. Засоби оцінювання здобувачів вищої освіти

Питання для підсумкового контролю (екзамену):

1. Основні поняття ризик-менеджменту.
2. Основні компоненти ризику: поняття, функції, причини і фактори виникнення ризиків.
3. Невизначеність та ризик.
4. Класифікація ризиків.
5. Основні види підприємницьких ризиків: ризики підприємства, транспортні ризики.
6. Ідентифікація ризиків в логістичних ланцюгах.
7. Принципи та послідовність проведення аналізу ризиків.
8. Методи аналізу ризиків: загальна характеристика методів оцінки ризиків.
9. Статистичний метод оцінки ризиків.
10. Метод аналізу доцільності витрат.
11. Метод експертних оцінок.
12. Аналітичний метод оцінки ризиків.
13. Метод використання аналогів
14. Метод аналізу ризику за допомогою дерева рішень.
15. Комплексна оцінка ризиків.
16. Стрес - тестінг компанії.
17. Сутність управління ризиками.
18. Система ризик-менеджменту.
19. Методи управління ризиками та їх вибір.
20. Особливості управління ризиками підприємства.
21. Ризик та психологічна теорія рішень.
22. Особливості управління логістичними ризиками.
23. Розвиток організаційної структури управління ризиками компанії.
24. Основні поняття, види та методи страхування.

25. Характеристика страхового ринку.
26. Основні види страхування.
27. Страхування в логістичних системах.
28. Відповідальність менеджменту за управління ризиком.
29. Комплексний ризик-менеджмент.
30. Елементи процесу ризик-менеджменту.
31. Особливості виявлення операційних ризиків.
32. Особливості оцінки ймовірності операційних ризиків.
33. Характеристика світових стандартів ризик-менеджменту.
34. Призначення та основні положення міжнародних стандартів ризик-менеджменту ISO 31000:2018 «Ризик-менеджмент» (Risk management – Guidelines), COSO ERM «Управління ризиками організацій».
35. Інтегрована модель», FERMA «Управління ризиками Федерації європейських асоціацій ризик-менеджменту».
36. Впровадження міжнародних стандартів на вітчизняних підприємствах.