

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ЕКОНОМІКО-ТЕХНОЛОГІЧНИЙ ІНСТИТУТ
Кафедра маркетингу, менеджменту та економіки

ЗАТВЕРДЖУЮ

Ректор

_____ І.М. Василенко

” _____ ” _____ 2023р.

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

з дисципліни «Управління ризиками на підприємстві»

Галузь знань 07 Управління та адміністрування
Спеціальність 073 Менеджмент

Форма навчання	курс	семестр	Всього годин за планом	Кількість кредитів ECTS	Всього аудитор.(год)	Аудиторних годин (у тому числі КЗ)			Самос. робота (год)	Контрольні (мод.)роботи (шт)	Розрахунково-гафічні роботи(шт)	Курсові проекти (роботи) (шт)	залік	Екзамен (сем)
						лекції	лабораторні	практичні						
Денна	1	1	120	4	72	36		36	48					
Заочна	1	1	120	4	12	8		4	108					

м. Кропивницький 2023р.

Робочу програму складено на основі освітньої програми за спеціальністю 073
«Менеджмент»

Робочу програму затверджено на засіданні кафедри маркетингу, менеджменту та економіки

протокол № від 2023 р.

Завідувач кафедри маркетингу, менеджменту та економіки

_____ / О. В. Павлова /

„ _____ ” _____ 2023р

Погоджено

Гарант ОП _____

Схвалено вченою радою.

Протокол № від 2023р.

Голова _____ / С.А. Фрунза /

ОПИС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Найменування показників	Галузь знань, напрям підготовки, освітньо-кваліфікаційний рівень	Характеристика навчальної дисципліни	
		денна форма навчання	заочна форма навчання
Кількість кредитів – 4	Галузь знань 07 «Управління і адміністрування» Напрямок підготовки 073 Менеджмент	Обов’язкова	
Залікових модулів – 2	Спеціальність (професійне спрямування): Менеджмент	Рік підготовки:	
Змістових модулів – 2		1-й	
Індивідуальне науково-дослідне завдання -		Семестр	
Загальна кількість годин – 120		1-й	
Тижневих годин для денної форми навчання: аудиторних – 4 самостійної роботи студента – 2,4	Освітньо-кваліфікаційний рівень: другий (магістерський)	Лекції	
		36 год.	8 год.
		Практичні	
		36 год.	4 год.
		Семінари	
		0 год.	0 год.
		Лабораторні	
		0 год.	0 год.
		Самостійна робота	
		48 год.	108 год.
		Індивідуальні завдання: 0 год.	
		Вид контролю: Залік	

Примітка.

Співвідношення кількості годин аудиторних занять до самостійної і індивідуальної роботи становить: для денної форми навчання – 60% до 40%, для заочної форми навчання – 10% до 90%.

ПЕРЕЛІК ПЛАНОВАНИХ РЕЗУЛЬТАТІВ НАВЧАННЯ, СПІВВІДНЕСЕНИХ З ПЛАНОВАНИМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЄННЯ ОСВІТНЬО-ПРОФЕСІЙНОЇ ПРОГРАМИ

За результатами вивчення дисципліни здобувач повинен опанувати наступні **компетентності**:

Загальні компетентності (ЗК):

ЗК 1 Здатність проведення досліджень на відповідному рівні;

ЗК 6 Здатність генерувати нові ідеї (креативність);

Фахові компетентності спеціальності (СК):

СК 1 Здатність обирати та використовувати концепції, методи та інструментарій менеджменту, в тому числі у відповідності до визначених цілей та міжнародних стандартів;

СК 4 Здатність до ефективного використання та розвитку ресурсів організації;

СК 10 Здатність до управління організацією та її розвитком.

У результаті вивчення навчальної дисципліни студент повинен:

знати:

- про основні поняття ризик-менеджменту;
- сутність і функції ризик-менеджменту;
- сутність ризиків і їх класифікацію;
- уявлення про стратегічний (комплексний) і функціональний ризик-менеджмент на підприємстві: операційний, фінансовий, зовнішньоекономічний, маркетинговий;

- про моделі виміру ризику в маркетингу;

- про спеціалізовані комп'ютерні програми для управління ризиками;

У результаті вивчення навчальної дисципліни студент повинен:

вміти:

- виявляти і класифікувати ризики підприємства;
- обґрунтовувати методи впливу на ризики діяльності підприємства;
- складати програму ризик-менеджменту в рамках усього підприємства;
- складати анкети та обробляти за допомогою програми SPSS матеріали опитування, які стосуються сприйманих ризиків.

Програмні результати навчання (Р):

Р1 – критично осмислювати, вибирати та використовувати необхідний науковий, методичний і аналітичний інструментарій для управління в непередбачуваних умовах;

Р2 – ідентифікувати проблеми в організації та обґрунтовувати методи їх вирішення;

Р4 – обґрунтовувати та управляти проектами, генерувати підприємницькі ідеї;

Р6 – мати навички прийняття, обґрунтування та забезпечення реалізації управлінських рішень в непередбачуваних умовах, враховуючи вимоги чинного законодавства, етичні міркування та соціальну відповідальність;

Р 13. Вміти планувати і здійснювати інформаційне, методичне, матеріальне, фінансове та кадрове забезпечення організації (підрозділу).

СТРУКТУРА ЗАЛІКОВИХ МОДУЛІВ ТА РОЗПОДІЛ ЧАСУ НА ЇХ ЗАСВОЄННЯ

Назви змістових модулів і тем	Кількість годин											
	Денна форма						Заочна форма					
	усього	у тому числі					усього	у тому числі				
		л	п	с	інд	с.р.		л	п	с	інд	с.р.
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Змістовий модуль 1. Загальні категорії прогнозування та планування ризику												
Тема 1. Прогнозування ризиків: сутність, предмет і об'єкт	6	2	2			2	6	1				5
Тема 2. Моделювання економічного ризику	6	2	2			2	6	1				5
Тема 3. Система економічного прогнозування ризику	6	2	2			2	6					6
Тема 4. Система соціального ризик-прогнозування	6	2	2			2	6					6
Тема 5. Методи технічного аналізу ризику	8	2	2			4	8					8
Тема 6. Екстраполяційні методи прогнозування виникнення ризику	8	2	2			4	8	1				7
Тема 7. Експертні методи прогнозування ризику	8	2	2			4	8					8
Тема 8. Методичні підходи до економічного прогнозування ризику	6	2	2			2	6		1			5
Тема 9. Ризик-моделі окремих галузей економіки	6	2	2			2	6		1			5
Разом за змістовим модулем 1.	60	18	18			24	60	3	2			55
Змістовий модуль 2. Науково-теоретичні засади управління ризиками підприємства												
Тема 10. Сутність ризику як економічної категорії. Функції ризику	8	2	2			8	8					8
Тема 11. Класифікація ризиків підприємства	6	2	2			6	6					6
Тема 12. Управління ризиками на підприємстві	8	2	2			2	8	1				7
Тема 13. Система антикризових заходів на підприємстві	6	2	2			2	6	1				5
Тема 14. Оцінювання ризику діяльності підприємств	8	2	2			2	8		1			7
Тема 15. Програма управління ризиками на підприємстві	6	2	2			2	6	1	1			4
Тема 16. Управління	6	2	2			2	6					6

інвестиційними ризиками												
Тема 17. Управління фінансовими ризиками	6	2	2			2	6					6
Тема 18. Ризик-менеджмент у сфері маркетингу	6	2	2			2	6					6
Разом за змістовим модулем 2.	60	18	18			24	60	3	2			55
Усього годин	120	36	36			48	120	6	4			110

Змістовий модуль 1

Загальні категорії прогнозування та планування ризику (60 год.)

Тема 1. Прогнозування ризиків: сутність, предмет і об'єкт.

Прогноз та прогнозування ризиків. Економічне прогнозування та планування як наукова дисципліна. Форми економічного прогнозування.

Етапи і завдання економічного прогнозування ризиків.

Тема 2. Моделювання економічного ризику.

Модель як інструмент дослідження об'єкта. Моделі економічного ризику. Моделі майбутньої світової цивілізації. Моделі ймовірності економічної динаміки виникнення ризику.

Тема 3. Система економічного прогнозування ризику.

Економічне прогнозування ризику: основні поняття і складові.

Прогнозування природних ресурсів та їх залучення в господарську діяльність.

Тема 4. Система соціального ризик-прогнозування.

Прогнозування демографічного розвитку. Прогнозування науково-технічного прогресу та його впливу на соціальну складову.

Тема 5. Методи технічного аналізу ризику.

Історія виникнення і сфера застосування технічного аналізу. Сфера застосування методів технічного аналізу у ризикології. Графічні методи прогнозування ризику. Ціновий тренд, його основні властивості.

Тема 6. Екстраполяційні методи прогнозування виникнення ризику.

Метод екстраполяції тенденції як один із методів прогнозування ризику. Дисконтування в прогностиці. Екстраполяція та її види.

Тема 7. Експертні методи прогнозування ризику.

Сфера застосування експертних методів. Метод експертних оцінок «Делфі». Метод колективної генерації ідей. Побудова сценаріїв і прогнозні графі у ризикології.

Тема 8. Методичні підходи до економічного прогнозування ризику.

Функції прогнозування. Класифікація об'єктів прогнозування.

Тема 9. Ризик-моделі окремих галузей економіки.

Моделі зовнішньої торгівлі. Моделі народного господарства. Моделі організації виробництва. Моделі фондового ринку.

Змістовий модуль 2.

Науково-теоретичні засади управління ризиками підприємства (60 год.)

Тема 10. Сутність ризику як економічної категорії. Функції ризику.

Сутність ризику та причини його виникнення. Функції ризику. Особливості прояву ризику в сучасних умовах.

Тема 11. Класифікація ризиків підприємства

Традиційний підхід щодо класифікації ризиків господарської діяльності підприємства. Класифікація ризиків в залежності від етапів життєвого циклу підприємства. Загальні ризики підприємства та їх характеристика.

Тема 12. Управління ризиками на підприємстві.

Поняття ризик-менеджменту, його мета та завдання. Принципи ризик-менеджменту.

Підходи до процесу управління ризиками. Характеристика етапів процесу ризик-менеджменту.

Тема 13. Система антикризових заходів на підприємстві.

Аналіз ризиків господарської діяльності підприємства. Класифікація втрат і їх оцінювання.

Основні шляхи і методи оптимізації ризику на підприємстві.

Тема 14. Оцінювання ризиків діяльності підприємства

Загальні методи оцінки ризику. Спеціальні методи оцінки ризику.

Тема 15. Програма управління ризиками на підприємстві

Установлення контексту ризику. Методи виявлення ризиків. Оцінка ризику. Складання карти ризиків. Рішення про управління ризиками. Методи управління ризиками.

Тема 16. Управління інвестиційними ризиками.

Принципи оцінки ефективності інвестиційних проектів. Види ризиків при оцінці проектів. Методи аналізу ризиків проектів.

Тема 17. Управління фінансовими ризиками

Поняття фінансового ризику. Принципи управління фінансовими ризиками. Схема управління фінансовим ризиками. Методи впливу на фінансові ризики.

Тема 18. Ризик-менеджмент у сфері маркетингу.

Ризики в маркетингу. Управління ризиками під час проведення маркетингових досліджень. Аналіз ризиків споживача.

ПОЛІТИКА І ПРОЦЕДУРИ

При вивченні дисципліни «Управління ризиками на підприємстві» викладач повинен дотримуватись вимог Кодексу честі викладача (<http://www.knu.edu.ua/normatyvna-baza/kodeksy>), а здобувач вищої освіти – Кодексу честі студента (<http://www.knu.edu.ua/normatyvna-baza/kodeksy>). Крім того, прошу дотримуватися таких правил:

1. Не спізнюватися на заняття; перед початком заняття вимкнути звук засобів зв'язку (мобільний телефон, смарт-годинник тощо).

2. Не пропускати заняття без поважної причини, у разі відсутності прошу попередити та опрацювати матеріал самостійно.

3. Здійснювати попередню підготовку до лекційних та практичних занять згідно з переліком рекомендованої літератури.

4. Згідно з календарним графіком навчального процесу здавати всі види контролю.

5. Брати активну участь в навчальному процесі.

6. Бути терпимими, відвертими і доброзичливими до однокурсників та викладачів, а також відкритими до конструктивної критики.

7. У процесі навчання дотримуватись принципів академічної доброчесності.

МЕТОДИ КОНТРОЛЮ І ПОРЯДОК ОЦІНЮВАННЯ РЕЗУЛЬТАТІВ НАВЧАННЯ

Методами контролю з дисципліни «Управління ризиками на підприємстві» є поточний та підсумковий контроль.

Поточний контроль здійснюється під час проведення лекційних і семінарських (практичних) занять та має на меті перевірку рівня підготовленості студента до виконання конкретної роботи. Формами проведення поточного контролю з дисципліни є: усні опитування; поточне тестування; виконання самостійної роботи тощо.

Активна робота під час аудиторних занять також може оцінюватись викладачем певною кількістю додаткових балів по кожній темі.

Підсумковий контроль з дисципліни «Управління ризиками на підприємстві» включає семестровий контроль у формі екзамену (виконання тестових завдань на комп'ютері та співбесіда з викладачем).

Загальний бал визначається сумуванням всіх балів отриманих при вивченні даної дисципліни. Результати фіксуються у балах та перераховуються в оцінки за національною шкалою та шкалою ECTS.

Розподіл балів з дисципліни для студентів денної форми навчання (максимальна кількість балів)

Поточне оцінювання за темами	СРС	Заліковий тест	Разом
T1-T18 (3 бали за тему)	T1-T18 (по 1,5 бали за тему)	40	100
36	24		
60			

Критерії оцінювання навчальних досягнень студентів на семінарських (практичних) заняттях

Макс. кількість балів	Критерії оцінювання навчальних досягнень
3	Оцінюється робота студента, який у повному обсязі володіє навчальним матеріалом, вільно, самостійно та аргументовано його викладає, глибоко та всебічно розкриває зміст теоретичних запитань та практичних завдань, використовуючи при цьому обов'язкову та додаткову літературу, вільно послуговується науковою термінологією, розв'язує задачі стандартним або оригінальним способом, наводить аргументи на підтвердження власних думок, здійснює аналіз та робить висновки

2	Оцінюється робота студента, який відтворює значну частину навчального матеріалу, висвітлює його основний зміст, виявляє елементарні знання окремих положень, записує основні формули, рівняння, закони. Не здатний до глибокого, всебічного аналізу, обґрунтування та аргументації, не користується необхідною літературою, допускає істотні неточності та помилки
1	Оцінюється робота студента, який не в змозі викласти зміст більшості питань теми та курсу, володіє навчальним матеріалом на рівні розпізнавання явищ, допускає істотні помилки, відповідає на запитання, що потребують однослівної відповіді.
0	Оцінюється робота студента, який не володіє навчальним матеріалом та не в змозі його висвітлити, не розуміє змісту теоретичних питань та практичних завдань.

При оцінюванні конспекту з відповідями по самостійній роботі студента оцінюється своєчасність та повнота відповідей на питання.

Студент вважається допущеним до екзамену, якщо він отримав за поточну та самостійну роботу мінімум 35 балів.

Розподіл балів з дисципліни для студентів заочної форми навчання (макс. кількість балів)

Контрольна робота (захист реферату, складання плану антикризових заходів на прикладі діючого підприємства)	Залік	Разом
60	40	100

Розподіл балів при оцінюванні контрольної роботи студента заочної форми навчання:

Максимальна кількість балів за оцінюванні конспекту з відповідями по самостійній роботі студента							Всього
Своєчасність виконання		Своєчасність Захисту		Якість	Захист	Самостійність виконання	
вчасно	невчасно	вчасно	невчасно				
10	0	10	0	10	10	20	60

Якщо оцінка виконання та захисту КР нижче граничного рівня – 20 балів, то така робота вважається невиконаною або незахищеною. Бали за таку роботу нараховуються тільки після її доведення до відповідного (необхідного) рівня виконання.

Шкала оцінювання: національна та ECTS

Сума балів за всі види навчальної діяльності	Оцінка ECTS	Оцінка за національною шкалою	
		для екзамену, курсового проекту (роботи), практики	для заліку
90-100	A	відмінно	зараховано
80-90	B	добре	
71-79	C		
61-70	D	задовільно	
50-60	E		

30-49	FX	незадовільно з можливістю повторного складання	не зараховано з можливістю повторного складання
0-29	F	незадовільно з обов'язковим повторним вивченням дисципліни	не зараховано з обов'язковим повторним вивченням дисципліни

Рекомендована література

Базова:

1 Керування ризиком. Методи загального оцінювання ризику (IEC/ISO 31010:2009, IDT). ДСТУ IEC/ISO 31010:2013. – К. : Мінекономрозвитку України, 2015. – 73 с.

2. Бадалова А. Г. Управление рисками деятельности предприятия: Учебное пособие / А. Г. Бадалова, А. В. Пантелеев. – М. : Вузовская книга, 2016. – 234 с.

3 Белов П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч.: Учебник и практикум для бакалаврата и магистратуры / П. Г. Белов. – Люберцы : Юрайт, 2016. – 211 с.

4. Васин С. М. Управление рисками на предприятии / С. М. Васин, В. С. Шутов. – М. : КноРус, 2018. – 304 с.

5. Воронцовский А. В. Управление рисками : Учебник и практикум для бакалаврата и магистратуры / А. В. Воронцовский. – Люберцы : Юрайт, 2016. – 414 с.

6. Вяткин В. Н. Риск-менеджмент / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. – М. : Юрайт, 2016. – 354 с.

7. Грачева М. В. Проектный анализ : учет рисков / Учебно-практическое пособие. – Москва : Проспект, 2017. – 176 с.

8. Антонов Г. Д. Управление рисками организации : учебное пособие / Г. Д. Антонов, О. П. Иванова, В. М. Тумин. – М. : НИЦ ИНФРА-М, 2017. – 153 с.

9. Круи М. Основы риск-менеджмента / М. Круи, Д. Галэй, Р. Марк. – М. : Юрайт, 2017. – 392 с.

Додаткова

10. Сніщенко Р. Г. Проблеми економічної безпеки господарюючих суб'єктів в умовах нестабільності : монографія. Тернопіль: Крок, 2019. 276 с.

11. Сніщенко Р. Г. Служба економічної безпеки як гарант захисту бізнесової діяльності суб'єкта господарювання. *Вчені записки Таврійського національного університету імені В.І. Вернадського. Серія «Економіка і управління»*. 2020. Том 31(70). №3. С.209-216.

12. Сніщенко Р. Г. Визначення інтегрального індексу ефективності управління інноваціями у фінансовій безпеці учасників фінансового ринку.

Фінансово-кредитна діяльність: проблеми теорії та практики. 2018. № 1(24). С. 258–266.

13. Сніщенко Р. Г. Методологічні проблеми та особливості аналізу і оцінки стану фінансової безпеки учасників фінансового ринку. *Проблеми системного підходу в економіці.* 2017. № 5 (61). С. 210–215.

14. Сніщенко Р. Г. Definition semantic load the links between economic category «financial security» and «risk». *Вісник Маріупольського державного університету. Серія: Економіка.* 2016. № 11. С. 7–15.

15. Сніщенко Р. Г. Забезпечення економічної безпеки інфраструктурних підрозділів підприємств. *Перспективи розвитку науки і бізнесу в глобальному середовищі:* матеріали Міжнар. наук.-практ. конф. (м. Тернопіль, 20 трав. 2020 р.) Тернопіль : ТНЕУ, 2020. С. 61-62.

16. Сніщенко Р. Г. Політика фінансової безпеки як реалізатор захисту фінансових ресурсів учасників фінансового ринку. *Фінансове забезпечення діяльності суб'єктів господарювання* : зб. тез доп. VI Всеукр. наук.-практ. конф., (м. Кременчук, 5–6 берез. 2018 р.). Кременчук, 2018. С. 25–27.

17. Сніщенко Р. Г. Аспекти державної підтримки фінансової безпеки учасників фінансового ринку. *Сучасні детермінанти розвитку бізнес-процесів в Україні* : матеріали міжнар. наук.-практ. інтернет-конф., (м. Київ, 24 трав. 2017 р.). Київ, 2017. С. 345–347.

18. «ISECOM – Open Source Security Testing Methodology Manual (OSSTMM)». Retrieved 20 September 2014.

19. Allianz Risk Barometer 2015. URL: <http://www.agcs.allianz.com/insights/white-papers-and-case-studies/risk-barometer-2015>. (дата звернення 5.10.2020).

20. Bezpieczeństwo systemu finansowego / Ekonofizyki na Uniwersytecie Śląskim. URL: http://el.us.edu.pl/ekonofizyka/index.php/RF:Bezpieczeństwo_systemu_f finansowego. (дата звернення 15.10.2019).

21. Business Security & Surveillance / Dropcam. URL : <https://www.dropcam.com/small-business-security>. (дата звернення 3.10.2020).

22. Defining and achieving financial stability. William A. Allen and Geoffrey Wood. *Journal of Financial Stability*, 2006, vol. 2, issue 2, pages 152–172.

23. Langlois R. N. Rationality, institutions and explanation // *Economics as a Process. Essays in New the Institutional Economics*, ed. by R.N. Langlois. Cambridge, 1996. P. 225–255, P. 228.

24. Łazowski J. Wstęp do nauki o ubezpieczeniach. Wyd. 2. Warszawa : PZU, 1934. S. 7.

25. Threat Intelligence Index 2019. A Ponemon Institute IBM X-Force Network Report. URL: <https://www.ibm.com/account/reg/us-en/signup?formid=urx-42703>. (дата звернення 5.10.2020).

Інформаційні ресурси

1. <http://rrm.rea.ru>

2. <http://www.cfin.ru/>
3. <http://www.irmi.com/expert/articles/shah005.asp>
4. <http://www.jpmorgan.com>;
5. <http://www.riskcontrol.ru/>
6. <http://www.riskcontrol.ru/currency.shtml>
7. <http://www.riskcontrol.ru/stocks.shtml>
8. <http://www.riskmetrics.com/>