

**МІНІСТЕРСТВО ВНУТРІШНІХ СПРАВ УКРАЇНИ
ДНІПРОПЕТРОВСЬКИЙ ДЕРЖАВНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ВНУТРІШНІХ СПРАВ**

ФАКУЛЬТЕТ соціально-психологічної освіти та управління

КАФЕДРА аналітичної економіки та менеджменту

ЗАТВЕРДЖУЮ

Ректор

Дніпропетровського
державного університету

внутрішніх справ

полковник поліції

 **Андрій ФОМЕНКО**
28.08.2020

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТ

Освітній ступінь бакалавр

(для студентів 4-го курсу)

Спеціальність 073 «Менеджмент»

(магістрів)

Освітня програма «Фінансово-економічна безпека
та ризик-менеджмент» № 463 від 30 серпня 2016 р.

(назва, дата, № акту про затвердження)

Статус навчальної дисципліни: вибіркова

(обов'язкова або вибірка)

Мова навчання: українська

Дніпро 2020

Ризик-менеджмент // Робоча програма навчальної дисципліни. Дніпро: Дніпропетровський державний університет внутрішніх справ, 2020. с. 18

РОЗРОБНИК:

Калініченко З.Д. - доцент кафедри аналітичної економіки та менеджменту

РЕЦЕНЗЕНТИ:

1. **Каховська О.В.**, професор, професор кафедри обліку, економіки і управління персоналом підприємства, ДВНЗ «Придніпровська державна академія будівництва та архітектури», м. Дніпро.
2. **Савчук Л.М.**, професор, кандидат економічних наук, декан факультету комп'ютерних систем, енергетики та автоматизації, ДВНЗ «Національна металургійна академія України», м. Дніпро.

Розглянуто і схвалено на засіданні кафедри аналітичної економіки та менеджменту 30 липня 2020 р., протокол № 21

Рекомендовано Науково-методичною радою університету
25 серпня 2020 р., протокол № 12

Схвалено Вченою радою університету, рекомендовано для використання в освітньому процесі протягом трьох років 27 серпня 2020, протокол № 12

Метою вивчення навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент» є формування у здобувачів системи професійно важливих теоретичних знань і практичних умінь, здатних розв'язувати складні спеціалізовані задачі та прикладні проблеми, а також набуття навичок їх практичного використання при прийнятті управлінських рішень у сфері економічної діяльності підприємства та економічних відносин.

Мета вивчення дисципліни – формування системи знань про предмет і суть ризик-менеджменту, його місце в діяльності підприємств і вироблення практичних навичок аналізу ризиків на підприємстві в цілому та в різних його підрозділах, розуміння можливостей ризик-менеджменту для підвищення ефективності бізнесу.

Завдання дисципліни – дати здобувачам: знання 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 сприйманого ризику в маркетингу; про спеціалізовані комп'ютерні програми для управління ризиками; а також виробити вміння виявляти ризики і визначати методи впливу на них; скласти програму ризик-менеджменту в рамках усього підприємства.

Предмет дисципліни – принципи, методи та форми управління ризиками підприємства.

Вивчення «Ризик-менеджменту» спирається на знання, здобуті здобувачами з попередніх дисциплін. Так, дисципліна «Статистики» дозволяє здобувачам усвідомити такі поняття: математичне сподівання, дисперсія, стандартний відхилення тощо; дисципліна «Фінансовий менеджмент» – вивчити сутність фінансів, основні фінансові показники; дисципліна «Менеджмент і адміністрування» – розуміти суть аналізу факторів зовнішнього маркетингового середовища і SWOT-аналізу.

Здобувачам необхідні навички з управління фінансово-економічною безпекою, розуміння природи економічного ризику, сучасних підходів до його аналізу та оцінювання, методів обґрунтування управлінських рішень в умовах невизначеності, конфліктності, нестачі статистичної інформації, при наявності некерованих індетермінованих чинників тощо.

Особливу увагу приділено інтерпретації випадкових подій і величин в економічній діяльності при організації системи економічної безпеки на підприємствах України.

Дисципліна має практичну спрямованість стосовно вирішення питань операційних форм оцінки ризику, оснований на імовірнісних категоріях. В економічній діяльності та менеджменті безпеки завжди потрібно враховувати вплив несприятливих факторів, невизначеності та ризику на очікувані результати. На економічні процеси завжди впливають некеровані чинники, а самі процеси розвиваються за умов невизначеності, ризику, нестачі необхідної інформації. У результаті вивчення дисципліни бакалаври повинні навчитись основним методам аналізу невизначеності та ризику, які використовуються під час прийняття управлінських рішень.

Вивчення навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент» передбачає досягнення такого кваліфікаційного рівня підготовки бакалавра, за якого він повинен здобути:

Загальні компетентності бакалавра з менеджменту

ЗК2 Здатність до застосовування концептуальних і базових знань, розуміння предметної області і професії менеджера

ЗК4 Здатність використовувати інформаційно-комунікаційні технології для пошуку, оброблення, аналізу та використання інформації з різних джерел, у тому числі іноземною мовою

ЗК7 Здатність до адаптації, креативності, генерування ідей та дій у новій ситуації

ЗК9 Здатність діяти на основі етичних міркувань, соціально відповідально і свідомо .

Загальнопрофесійні компетентності бакалавра з менеджменту

ПК1 Здатність визначати та описувати характеристики організації

ПК2 Здатність аналізувати результати діяльності організації, зіставляти їх з факторами впливу зовнішнього та внутрішнього середовища, визначати перспективи розвитку організації

ПК3 Вміння визначати функціональні області організації та зв'язки між ними

ПК7 Здатність оцінювати та забезпечувати якість виконуваних робіт

ПК9 Здатність аналізувати й структурувати проблеми організації, формувати обґрунтовані рішення

ПК11 Розуміти принципи права та використовувати їх у професійній діяльності

Спеціальні професійні компетентності бакалавра з менеджменту, спеціалізація фінансово-економічна безпека

ПК1.1 Здатність поєднувати в професійній діяльності питання теорії і практики забезпечення безпеки господарської діяльності, основні положення теорії ризиків і загроз безпеці господарської діяльності

ПК1.2 Здатність використовувати особливості та визначати органічний взаємозв'язок господарської діяльності з інтересами особистості, бізнесу і держави

ПК1.3 Здатність об'єднувати економічну, фінансову, інформаційну та кадрову функції безпеки в єдину комплексну систему забезпечення безпеки господарської діяльності з метою попередження і мінімізації можливих загроз

ПК1.4 Здатність використовувати сучасні інформаційні технології та методи протидії і запобігання внутрішнім й зовнішнім загрозам

ПК1.5 Здатність правильно оцінювати особливості середовища господарювання, його унікальні особливості і масштаби діяльності суб'єкта

господарювання, галузеву і регіональну специфіку

ПК1.6 Здатність здійснювати професійну діяльність на основі розвинутої правової культури та приймати обґрунтовані рішення відповідно до норм чинного законодавства

ПК1.7 Здатність розробляти моделі бізнес-процесів забезпечення фінансово-економічної безпеки господарської діяльності підприємства

Результати навчання за навчальною дисципліною «Ризик-менеджмент»

ВВР308 Знати основні поняття ризик-менеджменту; сутність і функції ризик-менеджменту; сутність ризиків і їх класифікацію

ВВР309 Знати стратегічний (комплексний) і функціональний ризик-менеджмент на підприємстві: операційний, фінансовий, зовнішньоекономічний, маркетинговий; моделі виміру сприйманого ризику в менеджменті; спеціалізовані комп'ютерні програми для управління ризиками

ВВР310 Вміти виявляти ризики і визначати методи впливу на них;

ВВР311 вміти складати програму ризик-менеджменту в рамках усього підприємства;

ВВР312 Вміти користатися Excel і спеціалізованими програмами з ризик-менеджменту;

ВВР313 Вміти складати анкети та обробляти за допомогою програми SPSS матеріали опитування, які стосуються сприйманих ризиків

Обсяг навчальної дисципліни:

Кількість годин – **120**;

кількість кредитів – **4**;

кількість годин самостійної роботи – **80**;

мова навчання: **українська.**

Форма підсумкового контролю: **залік**

Додатки 1.1, 1.2. (оновлюються щорічно).

Програма дисципліни

ТЕМА 1 КОНЦЕПТУАЛЬНІ ЗАСАДИ УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ

Поняття та сутнісна природа економічного ризику.

Поняття ризику. Необхідність врахування ризику при прийнятті рішень

Поняття зовнішнього середовища підприємства. Середовище безпосереднього та опосередкованого впливу і його характеристика

Невизначеність та ризик

Поняття невизначеності. Зв'язок невизначеності та ризику. Види невизначеності. Аналіз чинників невизначеності.

Причини виникнення економічного ризику. Зовнішні та внутрішні чинники ризику.

Поняття об'єкту, суб'єкту та джерела ризику. Ставлення до ризику суб'єктів прийняття рішень. Ризик як об'єктивно-суб'єктивна економічна категорія.

Класифікація ризиків.

Загальні засади класифікації ризиків. Типи й види ризиків, їх класифікація, особливості виникнення та дії. Динамічний і статичний ризик.

Спеціальні ризики. Системний ризик. Портфельний ризик.

ТЕМА 2 МЕТОДОЛОГІЧНІ ОСОБЛИВОСТІ ЯКІСНОГО ТА КІЛЬКІСНОГО АНАЛІЗУ РИЗИКУ

Абсолютне і відносне вираження ризику.

Оцінка ризику в абсолютному і відносному вираженні. Якісне суб'єктивне оцінювання ризику.

Кількісні показники і методи виміру економічного ризику. Класифікація можливих втрат і їх оцінка. Шкали градації ризику, що використовуються для прийняття рішень

Прийняття ризикованих рішень в умовах невизначеності середовища. Основні види критеріїв оптимальності при прийнятті рішень в умовах невизначеності. Методи аналізу ризиків в умовах невідомої об'єктивної реальності, невизначеності, ігор з природою

Спеціальні методи оцінки ризику. Евристична та комплексна оцінка ризику. Метод аналогій. Експертні методи оцінювання ризиків. Аналіз чутливості.

Оцінка ризику за допомогою дерева рішень. Оцінка систематичного ризику на стадії розробки й вибору проектних рішень

ТЕМА 3 КІЛЬКІСНИЙ АНАЛІЗ РИЗИКУ В СИСТЕМІ РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТУ

Кількісний аналіз ризику

Загальні підходи до кількісної оцінки ступеня ризику. Статистичний метод. Застосування ймовірності до оцінки рівня ризику.

Оцінка ступеня ризику в абсолютному виразі. Поняття сподіваного значення (математичного сподівання), дисперсії та середньоквадратичного

відхилення випадкової величини. Ризик як величина очікуваної невдачі.

Оцінка ступеня ризику у відносному виразі. Поняття коефіцієнта ризику та коефіцієнта варіації. Коефіцієнт сподіваних збитків.

Поняття допустимого, критичного та катастрофічного ризиків.

Визначення меж зони їх дії.

ТЕМА 4 ВИБІР ОПТИМАЛЬНОЇ СТРАТЕГІЇ В УМОВАХ РИЗИКУ, ПОВ'ЯЗАНОГО З КОНФЛІКТОМ ТА НЕВИЗНАЧЕНОСТЮ

Методи аналізу конфліктних ситуацій. Ризики, пов'язані з конфліктом при здійсненні проектів. Методи знаходження оптимальних стратегій.

Оцінка ступеня ризику у відносному виразі. Поняття коефіцієнта ризику та коефіцієнта варіації. Коефіцієнт сподіваних збитків.

Оцінка можливих результатів реалізації програми ризик-менеджменту в організації. Відповідальність менеджменту підприємства за якість управління ризиками. Ризик - менеджмент: дев'ять основних етапів діяльності

Культура ризик-менеджменту

ТЕМА 5 РИЗИК І ТЕОРІЯ КОРИСНОСТІ. СУТНІСТЬ ТЕОРЕТИКО-ІГРОВОЇ МОДЕЛІ ПРИЙНЯТТЯ РІШЕНЬ В УМОВАХ КОНФЛІКТУ.

Ризик і теорія корисності

Сутність концепції теорії корисності. Поняття корисності. Основні аксіоми теорії корисності. Поняття граничної корисності. Приклади побудови функції корисності під час прийняття рішення, обтяженого ризиком.

Корисність за Нейманом-Моргенштерном. Поняття лотереї, детермінованого еквівалента лотереї, премії за ризик.

Різне ставлення до ризику: схильність, нейтральність, несхильність. Функція корисності. Криві байдужості.

ТЕМА 6 ЕТАПИ ТА ОРГАНІЗАЦІЯ РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТУ

Основи управління ризиками в господарській діяльності підприємства.

Необхідність управління ризиком у спектрі економічних проблем. Загальні підходи до процесу управління ризиком у менеджменті.

Принципи і методи управління ризиком.

Уникнення ризику.

Попередження (запобігання) виникнення ризику.

Прийняття ризику.

Оптимізація (зниження) ступеня ризику.

Контроль ризику як метод його оптимізації (мінімізації).

Фінансування ризику як метод компенсації втрат

Розробка технологій та методів зниження негативного впливу ризиків на діяльність

Зовнішні способи зниження ризику: розподіл ризику, зовнішнє страхування. Внутрішні способи зниження ризику: лімітування; диверсифікація; створення резервів і запасів; здобуття додаткової інформації.

Програма управління ризиками в організації

Виявлення факторів ризику

Методи виявлення ризику

Фінансування ризику

Ознаки вдосконалення системи ризик-менеджменту (ISO 31000-2010)

Інструменти управління ризиками

Загальна класифікація інструментів ризик-менеджменту та класифікація засобів впливу на ризик Методи управління ризиками

Інструменти управління ризиками за сферами діяльності

Інструменти управління ризиками відповідно до етапу реалізації проекту

ТЕМА 7 ПЛАНУВАННЯ ВПЛИВУ НА РИЗИК. УПРАВЛІННЯ РИЗИКОМ

Планування впливу на ризик: методи і стратегія

Напрями профілактики ризиків: запобігання; мінімізація; диверсифікація; лімітування

ТЕМА 8 СПОСОБИ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ ЗНИЖЕННЯ НЕГАТИВНОГО ВПЛИВУ ФАКТОРІВ РИЗИКУ НА РЕЗУЛЬТАТИ

Концепція організації контролінгу ризиків у системі проектного менеджменту підприємства

Стратегічний ризик-менеджмент підприємницької та проектної діяльності і його особливості

Характеристики ризик-менеджменту залежно від стратегічних підходів до формування програми ризик-менеджменту

Інформація в системі управління підприємницькими та проектними ризиками. Спеціалізоване програмне забезпечення в ризик-менеджменті

Інформаційні технології для динамічного оцінювання і прогнозування ризиків, адаптації і побудови нових адекватних математичних моделей фінансових ризиків з урахуванням нових даних, критеріїв, вимог та уточнень

Управління ризиками проектів. Управління ризиками інновацій

Форма підсумкового контролю успішності навчання

Підсумковий контроль – це перевірка рівня засвоєння знань, навичок, вмінь та інших компетентностей за певний період навчання (навчальний семестр, навчальний рік).

З навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент» передбачено:

- для денної та заочної форм навчання – залік.

Критерії та засоби оцінювання успішності навчання

Розрахунок підсумкової оцінки з навчальної дисципліни:

Для денної форми навчання:

Розрахунок підсумкової оцінки з навчальної дисципліни «Теорія управління» здійснюється відповідно до формули:

$$П = ПК + З \leq 100,$$

де ПК – бали за поточний контроль (40-60 балів),

З – бали за результатами складання заліку

Розрахунок кількості балів за аудиторну роботу

$$A_d = (30 * B) / (5 * n), \text{ де}$$

B – отримані здобувачем бали на заняттях

n – кількість занять

Поточний контроль (ПК)			Підсумковий контроль Залік (З)/Екзамен (Е)
Аудиторна робота	Самостійна робота	Індивідуальна робота	
≤ 30	≤ 15	≤ 15	
≤ 60			≤ 40
Підсумкова оцінка у випадку заліку ($П = ПК + З \leq 100$)			
Підсумкова оцінка у випадку складання екзамену ($П = ПК + Е \leq 100$)			

Для заочної форми навчання:

Поточний контроль (ПК)			Підсумковий контроль Залік (З)/Екзамен (Е)
Аудиторна робота	Самостійна робота	Індивідуальна робота	
≤ 20	≤ 30	≤ 10	
≤ 60			≤ 40
Підсумкова оцінка у випадку складання заліку ($П = ПК + З \leq 100$)			
Підсумкова оцінка у випадку складання екзамену ($П = ПК + Е \leq 100$)			

Для навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент» засобами діагностики знань (успішності навчання) виступають: поточний контроль (може проводитись усно, письмово або у формі комп'ютерного тестування, колоквиуму, оцінювання виступів на семінарських заняттях, ділових чи імітаційних ігор тощо, під час як навчальних занять, так і індивідуальної та самостійної роботи, зокрема з використанням системи управління дистанційним навчанням «Moodle»).

Критерії оцінювання аудиторної роботи Здобувачів

Для навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент» засобами діагностики знань (успішності навчання) виступають: поточний контроль (проводиться у формі комп'ютерного тестування, з використанням системи управління дистанційним навчанням «Moodle»).

Бали	ПОЯСНЕННЯ
5	Питання, винесені на розгляд, засвоєні у повному обсязі; на високому рівні сформовані необхідні практичні навички та вміння; всі навчальні завдання, передбачені планом заняття, виконані в повному обсязі. Під час заняття продемонстрована стабільна активність та ініціативність. Відповіді на теоретичні питання, розв'язання практичних завдань, висловлення власної думки стосовно дискусійних питань ґрунтується на глибокому знанні чинного законодавства, теорії та правозастосовної практики
4	Питання, винесені на розгляд, засвоєні у повному обсязі; в основному сформовані необхідні практичні навички та вміння; всі передбачені планом заняття навчальні завдання виконані в повному обсязі з неістотними неточностями . Під час заняття продемонстрована ініціативність. Відповіді на питання, розв'язання практичних завдань, висловлення власної думки стосовно дискусійних питань переважно ґрунтується на знанні чинного законодавства, теорії та правозастосовної практики
3	Питання, винесені на розгляд, у цілому засвоєні ; практичні навички та вміння мають поверхневий характер , потребують подальшого напрацювання та закріплення; навчальні завдання, передбачені планом заняття, виконані , деякі види завдань виконані з помилками
2	Питання, винесені на розгляд, засвоєні частково, прогалини у знаннях не носять істотного характеру ; практичні навички та вміння сформовані недостатньо ; більшість навчальних завдань виконано , деякі з виконаних завдань містять істотні помилки , які потребують подальшого усунення
1	Курсант, студент, слухач не готовий до заняття , не знає більшої частини програмного матеріалу, з труднощами виконує завдання, невпевнено відтворює терміни і поняття, що розглядалися під час заняття, допускає змістовні помилки , не володіє відповідними вміннями і навичками, необхідними для розв'язання професійних завдань
0	Відсутність на занятті

Критерії оцінювання самостійної роботи Здобувачів

БАЛИ	ПОЯСНЕННЯ
11-15	Питання, винесені на самостійну роботу, засвоєні у повному обсязі; на високому рівні сформовані необхідні практичні навички та вміння; всі завдання, передбачені самостійною роботою, виконані в повному обсязі. Під час самостійної роботи продемонстрована стабільна активність та ініціативність. Відповіді на теоретичні питання та розв'язання практичних завдань, висловлення власної думки стосовно дискусійних питань ґрунтується глибокому знанні економічної теорії та практики.
6-10	Питання, винесені на розгляд, засвоєні у повному обсязі; в основному сформовані необхідні практичні навички та вміння; всі передбачені планом завдання виконані в повному обсязі з неістотними неточностями. Під час самостійної роботи продемонстрована ініціативність. Відповіді на питання, розв'язання практичних завдань, висловлення власної думки стосовно дискусійних питань переважно ґрунтується на знанні законодавства, економічної теорії та практики.
1-5	Питання, винесені на розгляд, у цілому засвоєні; практичні навички та вміння мають поверхневий характер, потребують подальшого напрацювання та закріплення; поставлені завдання, передбачені планом самостійної роботи, виконані, деякі види завдань виконані з помилками. Окремі питання засвоєні частково, прогалини у знаннях не носять істотного характеру; практичні навички та вміння сформовані недостатньо; більшість навчальних завдань виконано, деякі з виконаних завдань містять істотні помилки, які потребують подальшого усунення.

0	Здобувач не готовий до виконання самостійного завдання, не знає більшої частини програмного матеріалу, з труднощами виконує завдання, допускає змістовні помилки, не володіє відповідними вміннями і навичками, необхідними для розв'язання професійних завдань.
---	--

Критерії оцінювання індивідуальної роботи Здобувачів

БАЛИ	ПОЯСНЕННЯ
11-15	Питання, винесені на індивідуальну роботу, засвоєні у повному обсязі; на високому рівні сформовані необхідні аналітичні навички та практичні вміння; всі розрахункові завдання, передбачені індивідуальною роботою, виконані в повному обсязі. Під час індивідуальної роботи продемонстрована стабільна активність та ініціативність. Відповіді на теоретичні питання та розв'язання практичних завдань, висловлення власної думки стосовно дискусійних питань ґрунтується на глибокому знанні чинного законодавства, економічної теорії та практики.
6-10	Питання, винесені на розгляд, засвоєні у повному обсязі; в основному сформовані необхідні практичні навички та вміння; всі передбачені планом завдання виконані в повному обсязі з неістотними неточностями. Під час індивідуальної роботи продемонстрована ініціативність. Відповіді на питання, розв'язання практичних завдань, висловлення власної думки стосовно дискусійних питань переважно ґрунтується на знанні економічної теорії та практики.
1-5	Питання, винесені на розгляд, у цілому засвоєні; практичні навички та вміння мають поверхневий характер, потребують подальшого напрацювання та закріплення; поставлені завдання, передбачені планом індивідуальної роботи, виконані, деякі види завдань виконані з помилками. Окремі питання засвоєні частково, прогалини у знаннях не носять істотного характеру; практичні навички та вміння сформовані недостатньо; більшість навчальних завдань виконано, деякі з виконаних завдань містять істотні помилки, які потребують подальшого усунення.
0	Здобувач не готовий до виконання індивідуального завдання, не знає більшої частини програмного матеріалу, з труднощами виконує завдання, допускає змістовні помилки, не володіє відповідними вміннями і навичками, необхідними для розв'язання професійних завдань.

Засоби діагностики успішності навчання

Діагностика знань здійснюється у формі поточного та підсумкового контролю. Поточний контроль поєднує наступні види:

- тестування – дозволяє перевірити загальну підготовку до заняття;
- розв'язування задач – дозволяє перевірити знання основних положень заданої теми, формує логічне мислення,
- опитування – дозволяє оцінити рівень знань під час безпосереднього (інтерв'ю) або опосередкованого (анкетування) спілкування;
- контрольна робота – дозволяє оцінити рівень опанування навчального матеріалу з певної теми або їх сукупності; можуть бути аудиторними (виконуються під час аудиторних занять), домашніми (виконуються в домашніх умовах до певного терміну), поточними (дозволяють оцінити рівень знань з певної теми), екзаменаційними (дозволяють оцінити рівень знань з дисципліни в цілому), фронтальними (виконуються групою), індивідуальними;

– індивідуальні завдання – мають на меті поглибити, узагальнити та закріпити знання, а також застосовувати їх на практиці.

Підсумковий контроль: екзамен – дозволяє перевірити та оцінити отримані знання, уміння та ступінь опанування практичних навичок, а також розвиток творчого мислення в обсязі вимог програми навчальної дисципліни.

ПИТАННЯ ДЛЯ ПІДГОТОВКИ ДО ПІДСУМКОВОГО КОНТРОЛЮ

Поняття ризику та його оцінювання. Сутність економічного ризику. Необхідність врахування дії ризику в розв'язанні економічних завдань, що виникають під час прийняття господарських рішень.

Сутність ситуаційного підходу в менеджменті. Поняття зовнішнього середовища підприємства. Середовище безпосереднього та опосередкованого впливу. Характеристика зовнішнього середовища підприємства.

Поняття економічної системи, її властивості.

Невизначеність та ризик

Поняття невизначеності. Зв'язок невизначеності та ризику. Види невизначеності. Аналіз чинників невизначеності.

Причини виникнення економічного ризику. Зовнішні та внутрішні чинники ризику. Ризик як об'єктивно-суб'єктивна економічна категорія.

Поняття об'єкту, суб'єкту та джерела ризику. Ставлення до ризику суб'єктів прийняття рішень.

Класифікація ризиків. Якісний аналіз ризику

Загальні засади класифікації ризиків. Типи й види ризиків, їх класифікація, особливості виникнення та дії. Динамічний і статичний ризик.

Виробничий ризик. Комерційний ризик. Фінансовий (кредитний) ризик. Інвестиційний ризик. Ринковий ризик. Портфельний ризик.

Кількісний аналіз ризику

Загальні підходи до кількісної оцінки ступеня ризику. Статистичний метод. Застосування ймовірності до оцінки рівня ризику.

Метод аналогій. Експертні методи оцінювання ризиків. Аналіз чутливості.

Оцінка ступеня ризику в абсолютному виразі. Поняття сподіваного значення (математичного сподівання), дисперсії та середньоквадратичного відхилення випадкової величини. Ризик як величина очікуваної невдачі.

Оцінка ступеня ризику у відносному виразі. Поняття коефіцієнта ризику та коефіцієнта варіації. Коефіцієнт сподіваних збитків.

Поняття допустимого, критичного та катастрофічного ризиків.

Ризик і теорія корисності

Сутність концепції теорії корисності. Поняття корисності. Основні аксіоми теорії корисності. Поняття граничної корисності. Приклади побудови функції корисності під час прийняття рішення, обтяженого ризиком.

Корисність за Нейманом-Моргенштерном. Поняття лотереї, детермінованого еквівалента лотереї, премії за ризик.

Різне ставлення до ризику: схильність, нейтральність, несхильність. Функція корисності. Криві байдужості.

Управління ризиками в господарській діяльності підприємства

Необхідність управління ризиком у спектрі економічних проблем. Загальні підходи до процесу управління ризиком у менеджменті. Принципи прийняття рішень в умовах ризику.

Ризик і теорія корисності. Сутність теоретико-ігрової моделі. Прийняття рішень в умовах конфліктів. Ризик і теорія корисності

Сутність концепції теорії корисності. Поняття корисності. Основні аксіоми теорії корисності. Поняття граничної корисності. Приклади побудови функції корисності під час прийняття рішення, обтяженого ризиком.

Корисність за Нейманом-Моргенштерном. Поняття лотереї, детермінованого еквівалента лотереї, премії за ризик.

Різне ставлення до ризику: схильність, нейтральність, несхильність. Функція корисності.

Криві байдужості.

Моделювання економічного ризику та прийняття рішень

Поняття моделі. Сутність теоретико-ігрової моделі. Поняття конфліктної ситуації та стратегії гравця. Нижня ціна гри або максимін. Верхня ціна гри або мінімакс. Алгоритм знаходження рішення гри.

Економічне середовище у ролі гравця. Поняття інформаційної ситуації. Характеристики інформаційних ситуацій.

Функція ризику. Приклади кількісної оцінки ризику під час прийняття господарських рішень.

Прийняття рішень в умовах ризику. Критерії прийняття рішень в умовах ризику.

Критерій Байєса. Критерій Бернуллі-Лапласа. Критерій Гіббса-Джейнса. Критерій Вальда. Критерій мінімального ризику Севіджа. Критерій Гурвіца.

Організація ризик-менеджмента

Зміст управління ризиками

Об'єкт системи ризик-менеджменту

Процес управління ризиками та його основні суб'єкти.

Алгоритм процесу управління ризиками

Основні етапи формування ризик-менеджменту

Консолідований ризик організації та концепції управління ризиками

Концепція мінімізації ризику

Концепція допустимого ризику

Ризик як ресурс

Особливості ризик-менеджменту в сучасній організації

Організаційно-структурна схема служби ризик-менеджменту

Основні документи у сфері ризик-менеджменту

Характеристика ризик-менеджменту як різновиду управлінської діяльності

Етапи та організація ризик-менеджменту

Програма управління ризиками в організації

Виявлення факторів ризику

Методи виявлення ризику Методи управління ризиками

Фінансування ризику

Ознаки вдосконалення системи ризик-менеджменту (ISO 31000-2010)

Інструменти управління ризиками

Загальна класифікація інструментів ризик-менеджменту та класифікація засобів впливу на ризик

Інструменти управління ризиками за сферами діяльності

Інструменти управління ризиками відповідно до етапу реалізації проекту

Етапи реалізації програми ризик-менеджменту в організації

Відповідальність менеджменту організації за якість управління ризиками

Ризик - менеджмент: дев'ять основних етапів діяльності

Культура ризик-менеджменту

Планування впливу на ризик: методи і стратегія

Розробка технологій та методів зниження негативного впливу ризиків на діяльність

Напрями профілактики ризиків: запобігання; мінімізація; диверсифікація; лімітування

Розробка організаційної підтримки заходів ризик-менеджменту; реалізація рішень; після реалізаційний моніторинг.

Особливості організації управління ризиками в проектному та інноваційному ризик-менеджменті

Стадії забезпечення зниження негативного впливу факторів ризику на результати

Концепція організації контролінгу ризиків у системі проектного менеджменту підприємства

Стратегічний ризик-менеджмент підприємницької та проектної діяльності і його особливості

Характеристики ризик-менеджменту залежно від стратегічних підходів до формування програми ризик-менеджменту

Інформація в системі управління підприємницькими та проектними ризиками. Спеціалізоване програмне забезпечення в ризик-менеджменті

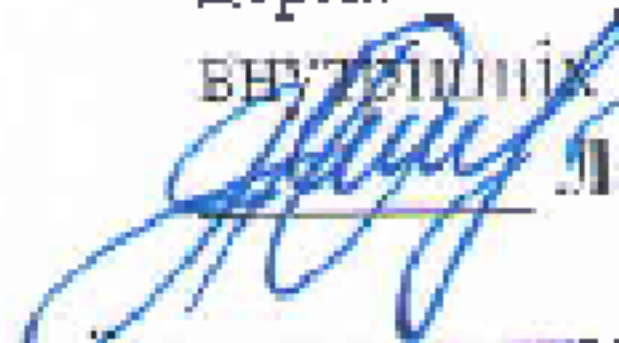
Інформаційні технології для динамічного оцінювання і прогнозування ризиків, адаптації і побудови нових адекватних математичних моделей фінансових ризиків з урахуванням нових даних, критеріїв, вимог та уточнень

Управління ризиками проектів. Управління ризиками інновацій

Додаток І.І.
до Робочої програми
з навчальної дисципліни

ЗАТВЕРДЖУЮ

Проректор Дніпропетровського
державного університету
внутрішніх справ


Лариса ЧАЛІВАЙКО

**ОБСЯГ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ
РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТ**

Освітній ступінь бакалавр
(у двох модулях вищої освіти)

Спеціальність 073 «Менеджмент»
(код і назва)

на 2020/2021 навчальний рік

Форма навчання: ДІПНА

Обсяг: **4 кредити ЄКТС (120 годин)**

Факультет соціально-психологічної освіти та управління

Курс **4** Група **Б-М-741**

Курс 4 1 група В-МІ/7+1							
№ теми згідно з РНЦД	Назва теми (згідно з РНЦД)	Загальний обсяг годин	Аудиторна робота				Самостійна та індивідуальна робота
			Всього	Лекцій	Семінари	Практич. заняття	
1	7 семестр	1	2	2	2	2	8
1	Концептуальні засади управління ризиками	12	4	2		2	10
2	Методологічні особливості якісного та кількісного аналізу ризику	14	4	1		2	10
3	Кількісний аналіз ризику в системі ризик-менеджменту	16	6	2	2	2	10
4	Вибір оптимальної стратегії в умовах ризику, пов'язаного з конфліктом та невиконачістю	16	6	2	2	2	10
5	Ризик і теорія кошеності. Сутність теоретико-ігрової моделі, прийняття рішень в умовах конфліктів	16	6	2	2	2	10
6	Етими та організація ризик-менеджменту	16	6	2	2	2	10
7	Планування впливу на ризик. Управління ризиком	16	6	2	2	2	10
8	Способи забезпечення зліжності негативного впливу факторів ризику на результати	12	2			2	10
Разом за семестр		120	40	14	10	16	80
Форма підсумкового контролю		Залік					

Розглянуто і схвалено на засіданні кафедри аналітичної економіки та менеджменту
Протокол від «30» липня 2020 р., № 21

Керівник кафедри

Олена ЦАРШИНА

ІНФОРМАЦІЙНЕ ТА МЕТОДИЧНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Ризик-менеджмент

Освітній ступінь **бакалавр**
(назва ступеня вищої освіти)

Спеціальність **073 Менеджмент**
(шифр і назва)

на **2020 / 2021** навчальний рік

Основні нормативні акти:

1. Господарський кодекс України. Документ 436-IV, чинний, поточна редакція . Редакція від 07.02.2019, підстава - 2473-VIII.
2. Закон України «Про державну реєстрацію юридичних осіб та фізичних осіб-підприємців».
3. Закон України «Про засади державної регуляторної політики у сфері господарської діяльності».
4. Указ Президента України від 1 червня 2005 року № 901/2005 «Про деякі заходи щодо забезпечення здійснення державної регуляторної політики».
5. Указ Президента України від 15 листопада 2000 року № 906/2000 «Про заходи щодо забезпечення підтримки та подальшого розвитку підприємницької діяльності».

РЕКОМЕНДОВАНА ЛІТЕРАТУРА

Основна

1. Матвійчук А. В. Аналіз і управління економічним ризиком / А. В. Матвійчук. К.: Центр навч. літ., 2015. 347 с.
2. Вітлінський В. В., Наконечний С. І., Шарапов О. Д. Економічний ризик і методи його вимірювання. К.: ІЗМН, 1996. 336 с.
3. Вічевич А. М., Максимець О. В. Аналіз зовніш-ньоекономічної діяльності: Навч. посіб. Львів.: Афіша, 2014. 140 с.
4. Вербицька Г. Л. Оцінка економічного ризику / Г. Л. Вербицька. Актуальні проблеми економіки. 2017. № 4. С. 129–136.
5. Лук'янова В. В. Економічний ризик / В. В. Лук'янова, Т. В. Головач. К.: Академвидав, 2017. 464 с.
6. Верес О. М. Ігрове імітаційне моделювання при управлінні підприємством в умовах ризику / О. М. Верес, О. О. Коць. Інформаційні системи та мережі. Вісн. Нац. ун-ту "Львівська політехніка". 2016. 561с. С. 76–85.
7. Азаренкова Г.М. Аналіз моделювання і управління ризиком (в схемах та прикладах) : навчальний посібник / Г. М. Азаренкова. Львів : Новий Світ-2000, 2015. 240 с.
8. Андрєєва Т.Є. Ризик у ринковій економіці : навчальний посібник /

Т.Є. Андрєєва, Т.Е. Петровська. Х. : Бурун Книга, 2015. 128 с

9. Андрійчук В. Менеджмент: прийняття рішень і ризик : навчальний посібник / В. Андрійчук, Л. Бауер. К. : КНЕУ, 1998. 316 с

10. Артими-Дрогомирецька, Зоряна. Економічний ризик : навчально-методичний посібник / З. Артим-Дрогомирецька, М. Негрей. Львів : Магнолія 2006, 2013. 320 с. : ил., табл., граф. - (Вища освіта в Україні)

11. Машина Н.І. Економічний ризик і методи його вимірювання : навчальний посібник / Н.І. Машина. - К. : Центр навч. літератури, 2003. 188 с

12. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання ризиків : навчальний посібник / за заг. ред. Л. І. Донець. К. : Центр учбової літератури, 2012. 472 с. : ил., табл., граф.

13. Останкова Л.А. Аналіз, моделювання та управління економічними ризиками : навчальний посібник / Л. А. Останкова, Н. Ю. Шевченко. К. : Центр учбової літератури, 2017. 256 с. : ил., табл., граф.

14. Примостка Л.О. Банківський менеджмент. Хеджування фінансових ризиків : навч. посібник / Л.О. Примостка. К. : КНЕУ, 2018. 108 с.

15. Старостіна А.О. Ризик-менеджмент: теорія та практика : навчальний посібник / А.О. Старостіна, В.А. Кравченко. К. : Політехніка, 2014. 200 с

16. Сулим М. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання ризиків : підручник / М. Сулим, О. Пенцак. - Львів : Новий Світ-2000, 2016. 330 с. : ил., табл., граф.

Додаткова

17. Вітлінський В.В. Врахування ризику та інфляції в моделюванні та оцінюванні інвестиційних проектів. К., 1995. - 11 с. -Деп. у КДЕУ 20.02.95, N 497 -Ук 95.

18. Вітлінський В.В. Економічний ризик: системний аналіз, менеджмент. - К., 1994. - 245 с. - Деп. у КДЕУ 17.10.94, N 2035 - Ук 94.

Розглянуто і схвалено на засіданні кафедри аналітичної економіки та менеджменту Протокол № 21 від «30» липня 2020 р.

Керівник кафедри

Олена ПАРШИНА