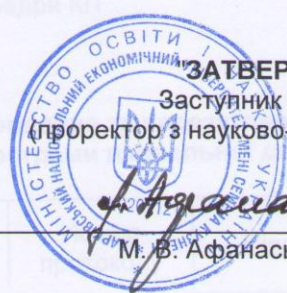


МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ

ХАРКІВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ ЕКОНОМІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ІМЕНІ СЕМЕНА КУЗНЕЦЯ

Розробник(-и):
Мілов О.В., к.т.н., доцент кафедри ІІТ



ЗАТВЕРДЖУЮ
Заступник керівника
(проректор з науково-педагогічної роботи)

М. В. Афанасьєв
М. В. Афанасьєв

Навчальний рік	Дата засідання кафедри – розробника РПНД

“РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТ”
робоча програма навчальної дисципліни

Галузьзнань **12 “ІНФОРМАЦІЙНІ ТЕХНОЛОГІЇ”**
Спеціальність **125 “КІБЕРБЕЗПЕКА”**
Освітнійрівень **другий (магістерський)**
Освітняпрограма **“КІБЕРБЕЗПЕКА”**

Виддисципліни **базова**
Мова викладання, навчання та оцінювання **українська**

Завідувач кафедри кібербезпеки та інформаційних технологій *С. П.* Євсєєв С.П.

Харків
ХНЕУ ім. С. Кузнеця
2019

ЗАТВЕРДЖЕНО
на засіданні кафедри кібербезпеки
та інформаційних технологій
Протокол № 1 від 26.08.2019 р.

Розробник(-и):
Мілов О.В., к.т.н., доцент кафедри КІТ

**Лист оновлення та перезатвердження
робочої програми навчальної дисципліни**

Навчальний рік	Дата засідання кафедри – розробника РПНД	Номер протоколу	Підпис завідувача кафедри

1. Вступ

Анотація навчальної дисципліни:

Подано тематичний план навчальної дисципліни й її змістовність за модулями та темами, вміщено плани лекцій і лабораторних занять, матеріал щодо закріплення знань (завдання для самостійної роботи, контрольні запитання), методичні рекомендації та оцінювання знань студентів.

Аналіз ризику, характерного для діяльності будь-якого підприємства, може допомогти знизити непередбачувані або випадково виникаючі витрати, пов'язані з вибором однієї з можливих альтернатив під час прийняття управлінського рішення особою будь-якого рівня управління. Урахування в діяльності суб'єктів господарювання факторів ризику дозволяє їм отримати певний ефект за мінімально можливих втрат під час здійснення фінансово-господарських операцій, реалізації інноваційно-інвестиційних проектів, проведенні інвестиційних розробок тощо. Сьогодення вимагає створення системи управління ризиками на підприємстві.

Навчальна дисципліна "Ризик-менеджмент" займає важливе місце у навчальному процесі, оскільки надає студентам методологічні, методичні знання, допомагає сформуванню практичних вмінь щодо аналізу, оцінювання і розроблення заходів, що допомагають ефективно управляти ризиками на підприємствах будь-якої форми власності.

Вивчення дисципліни "Ризик-менеджмент" сприятиме підвищенню рівня загальноєкономічної підготовки студентів, формуванню у них навичок науково-аналітичного опрацювання проблем з пошуку ефективних методів управління ризиками.

Мета навчальної дисципліни:

Метою викладання дисципліни "Ризик-менеджмент" є формування системи професійних компетентностей (знань і практичних вмінь та навичок) щодо використання теоретичних основ, методичних рекомендацій і практичних навичок для управління ризиками.

Курс	1	
Семестр	1	
Кількість кредитів ECTS	5	
Аудиторні навчальні заняття	лекції	18
	семінарські, практичні	–
	лабораторні	22
Самостійна робота		110
Форма підсумкового контролю	екзамен	

Структурно-логічна схема вивчення навчальної дисципліни:

Попередні дисципліни	Наступні дисципліни
Вища математика	Основи криптографічного захисту
Основна теорія баз даних	Основи технічного захисту інформації
Технології обробки інформації	Забезпечення інформаційної безпеки

2. Компетентності та результати навчання за дисципліною:

Компетентності	Результати навчання
Здатність формувати стратегію і тактику ризик-менеджменту підприємства	Ідентифікувати ключові ризики на підприємстві Володіти теоретичними положеннями, прикладними вміннями та практичними навичками щодо управління економічними ризиками суб'єктів господарювання Визначати особливості формування системи економічних ризиків підприємства
Здатність обґрунтовувати управлінські рішення на основі кількісної та якісної оцінки економічного ризику	Визначати основні етапи та стадії оцінювання економічних ризиків Формувати номенклатуру економічних ризиків, що впливає на конкретне управлінське рішення Володіти емпіричним арсеналом управління ризиками Вміти презентувати результати оцінювання економічних ризиків
Здатність визначати та застосувати прийоми і засоби зменшення рівня невизначеності та ризику	Володіти знаннями методичних основ розроблення та прийняття господарських рішень в умовах невизначеності Вміти обґрунтувати способи управління ризиками та їх вирішення Знати сутність системи управління економічними ризиками Вміти проводити процес управління економічними ризиками на конкретному підприємстві

3. Програма навчальної дисципліни

Тема 1. Основні поняття дисципліни

Визначення понять “ризик” і “ризик-менеджмент”. Об'єкт і предмет вивчення. Мета дисципліни. Природа ризиків. Ризик як постійна категорія в діяльності людини. Функції ризик-менеджера в організаційній структурі та його значення. Принципи розмежування обов'язків ризик-менеджера та інших функціональних одиниць в управлінській і господарюючій організації.

Тема 2. Підходи до класифікації ризиків

Ризик-менеджмент і вироблення підходів до класифікації ризиків. Підходи до класифікації ризиків у західних і пострадянських теоріях. Особливості класифікації ризиків у різних галузях управлінської та господарської діяльності. Ризики довгострокові й короткострокові, класифікація за принципами їх виявлення. Класифікація ризиків за прогнозованістю і наслідками.

Тема 3. Особливості ризиків у різних сферах діяльності

Ризики у кредитно-фінансовій діяльності. Особливості ризиків у торговому менеджменті. Організація виробництва, формування виробничих відносин та проблема ризиків. Ризикологія муніципального і державного управління. Впровадження інновацій і ризики. Ризики у кадровому менеджменті.

Тема 4. Технології оцінки небезпеки ризиків

Ризики поточної роботи організаційної структури та оцінка їх сумарного впливу на ефективність роботи. Приховані ризики і оцінка їх небезпеки. “Людський фактор” та ризики, пов’язані з ним, порівняння із ризиками іншого походження. Оцінка небезпек ризиків у поточній і довгостроковій перспективі.

Тема 5. Характерні ознаки ризиконебезпечної ситуації

Ризиконебезпеки в кадровій політиці. Визначення ступеня відповідальності кадрів різного рівня поставленим функціональним завданням. Особливості ознак ризиконебезпечної ситуації у торговому і фінансовому менеджменті. Ризиконебезпека і інституційної структури господарюючої або управлінської організації. Небезпеки ризиків нормативного походження.

Тема 6. Прогнозовані й непрогнозовані ризики

Характерні відмінності прогнозованих і непрогнозованих ризиків. Технології та шляхи заміщення непрогнозованих ризиків прогнозованими. Моделювання ситуацій та ділові ігри у виявленні непрогнозованих ризиків і пошуки шляхів подолання прогнозованих. Інструктаж первинний і поточний у запобіганні кадрових прогнозованих ризиків. Поточна звітність та її організація як фактор виявлення непрогнозованих ризиків.

Тема 7. Форс-мажорні ситуації, їх види

Поняття форс-мажорної ситуації. Нормативне забезпечення форс-мажору в ділових відносинах. Форс-мажорна ситуація як фактор стримування ділової активності. Політичні й інституційні ризики державної політичної системи і створювані ними форс-мажорні обставини. Форс-мажорні ситуації, спричинені природними факторами, економічною та міжнародною ситуацією. Особливості ризик-менеджменту в форс-мажорних обставинах.

Тема 8. Стратегічне прогнозування ризиків

Загальне поняття стратегічного ризику. Стратегічні ризики фінансового характеру. Кадрові кризи (фізичне і моральне старіння кадрів). Поняття стратегії запобігання й уникання ризиків.

Теми лабораторних робіт

Лабораторна робота 1. Методи оцінювання ризику безпеки.

Лабораторна робота 2. Кількісні методи оцінювання ризиків

Лабораторна робота 3. Якісні методи оцінювання ризиків, сутність та характеристика.

Лабораторна робота 4. Дерева прийняття рішень. Програма TreePlan.

Лабораторна робота 5. Методи групового прийняття рішень в умовах ризику.
Лабораторна робота 6. Критерії Вальда, мінімакний та максимінний критерії.

4. Порядок оцінювання результатів навчання

Система оцінювання сформованих компетентностей у студентів враховує види занять, які згідно з програмою навчальної дисципліни передбачають лекційні та лабораторні заняття, а також виконання самостійної роботи. Оцінювання сформованих компетентностей у студентів здійснюється за накопичувальною 100-бальною системою. Відповідно до Тимчасового положення “Про порядок оцінювання результатів навчання студентів за накопичувальною бально-рейтинговою системою” ХНЕУ ім. С. Кузнеця, контрольні заходи включають:

поточний контроль, що здійснюється протягом семестру під час проведення лекційних та лабораторних занять і оцінюється сумою набраних балів (максимальна сума – 60 балів; мінімальна сума, що дозволяє студенту скласти іспит, – 35 балів);

модульний контроль, що проводиться у формі колоквиуму як проміжний міні-екзамен з ініціативи викладача з урахуванням поточного контролю за відповідний змістовий модуль і має на меті *інтегровану* оцінку результатів навчання студента після вивчення матеріалу з логічно завершеної частини дисципліни – змістового модуля;

підсумковий/семестровий контроль, що проводиться у формі семестрового екзамену, відповідно до графіку навчального процесу.

Порядок проведення поточного оцінювання знань студентів. Оцінювання знань студента під час лабораторних занять та виконання індивідуальних завдань проводиться за такими критеріями:

розуміння, ступінь засвоєння теорії та методології проблем, що розглядаються; ступінь засвоєння фактичного матеріалу навчальної дисципліни; ознайомлення з рекомендованою літературою, а також із сучасною літературою з питань, що розглядаються; вміння поєднувати теорію з практикою при розгляді виробничих ситуацій, розв’язанні задач, проведенні розрахунків у процесі виконання індивідуальних завдань та завдань, винесених на розгляд в аудиторії; логіка, структура, стиль викладу матеріалу в письмових роботах і при виступах в аудиторії, вміння обґрунтовувати свою позицію, здійснювати узагальнення інформації та робити висновки; арифметична правильність виконання індивідуального та комплексного розрахункового завдання; здатність проводити критичну та незалежну оцінку певних проблемних питань; вміння пояснювати альтернативні погляди та наявність власної точки зору, позиції на певне проблемне питання; застосування аналітичних підходів; якість і чіткість викладення міркувань; логіка, структуризація та обґрунтованість висновків щодо конкретної проблеми; самостійність виконання роботи; грамотність подачі матеріалу; використання методів порівняння, узагальнення понять та явищ; оформлення роботи.

Загальними критеріями, за якими здійснюється оцінювання позааудиторної самостійної роботи студентів, є: глибина і міцність знань, рівень мислення, вміння систематизувати знання за окремими темами, вміння робити обґрунтовані висновки, володіння категорійним апаратом, навички і прийоми виконання практичних завдань, вміння знаходити необхідну інформацію, здійснювати її систематизацію та обробку, самореалізація на лабораторних заняттях.

Підсумковий контроль знань та компетентностей студентів з навчальної дисципліни здійснюється на підставі проведення семестрового екзамену,

завданням якого є перевірка розуміння студентом програмного матеріалу в цілому, логіки та взаємозв'язків між окремими розділами, здатності творчого використання накопичених знань, вміння формулювати своє ставлення до певної проблеми навчальної дисципліни тощо.

Екзаменаційний білет охоплює програму дисципліни і передбачає визначення рівня знань та ступеня опанування студентами компетентностей.

Кожен екзаменаційний білет складається із 2 практичних ситуацій та теоретичного питання, які передбачають вирішення типових професійних завдань фахівця на робочому місці та дозволяють діагностувати рівень теоретичної підготовки студента і рівень його компетентності з навчальної дисципліни.

Результат семестрового екзамену оцінюється в балах (максимальна кількість – 40 балів, мінімальна кількість, що зараховується, – 25 балів) і проставляється у відповідній графі екзаменаційної "Відомості обліку успішності".

Студента слід **вважати атестованим**, якщо сума балів, одержаних за результатами підсумкової/семестрової перевірки успішності, дорівнює або перевищує 60. Мінімумально можлива кількість балів за поточний і модульний контроль упродовж семестру – 35 та мінімумально можлива кількість балів, набраних на екзамені, – 25.

Підсумкова оцінка з навчальної дисципліни розраховується з урахуванням балів, отриманих під час екзамену, та балів, отриманих під час поточного контролю за накопичувальною системою. Сумарний результат у балах за семестр складає: "60 і більше балів – зараховано", "59 і менше балів – не зараховано" та заноситься у залікову "Відомість обліку успішності" навчальної дисципліни.

Розподіл балів за тижнями

(вказати засоби оцінювання згідно з технологічною картою)

Теми змістового модуля		Лекційні заняття	Захист лабораторних робіт	Поточні КР	Усього
Тема 1	1 тиждень	1	4	-	5
Тема 2	2 тиждень	1	4	-	5
Тема 3	3 тиждень	1	4	-	5
Тема 4	4 тиждень	1	4	10	15
Тема 5	5 тиждень	1	4	-	5
Тема 6	6 тиждень	1	4	-	5
Тема 7	7 тиждень	1	4	-	5
Тема 8	8 тиждень	1	4	10	15
Екзамен	10 тиждень				40
Усього		8	32	20	100

Шкала оцінювання: національна та ЄКТС

Сума балів за всі види навчальної діяльності	Оцінка ЄКТС	Оцінка за національною шкалою	
		для екзамену, курсового проекту (роботи), практики	для заліку
90 – 100	A	відмінно	зараховано
82 – 89	B	добре	
74 – 81	C		

64 – 73	D	задовільно	
60 – 63	E		
35 – 59	FX	незадовільно	не зараховано
1 – 34	F		

5. Рекомендована література

5.1 Основна

1. Вітлінський В. В., Наконечний С. І. Ризик у менеджменті. — К.: Бо-рисфен-М, 1996. — 336 с.
2. Вітлінський В. В., Великоіванешо Г. і. Ризикологія в економіці та підприємстві: Моногр. — К.: КНЕУ, 2004. — 480 с.
3. Вітлінський В. В., Верченко П. і., Наконечний Я. С., Сігал А. В. Економічний ризик: ігрові моделі: Навч. посіб. — К.: КНЕУ, 2002. — 446 с.
4. Арсеньев Ю. Н., Давыдова Т. Ю., Давыдов И. Н., Шлапаков И. М. Основы теории безопасности и рискологии. — М.: Высш. шк., 1999.
5. Архипов В. М., Верховская О. Р. Предпринимательские стратегии Учеб, пособие. — СПб.: Изд-во СПбГУЭиФ, 2002.
6. Багиева М. Н. Концептуальные основы анализа и оценки рисков предприятия: Учеб, пособие / Под ред. Д. В. Сокол. — СПб.: Изд-во СПбГУЭФ, 2001.
7. Юкаева В. С. Управленческие решения. — М.: Издат. дом “Дашков и КО”, 1999.
8. И. Балабанов И. Т. Риск-менеджмент. - М.: Финансы и статистика, 1996.
9. Большов А. В., Хайруллина А.Д. Риск-менеджмент.— Казань: Изд-во КФЭИ, 1999.
10. Буренина Г. А. Стратегический анализ рисков промышленного предприятия. — СПб.: Изд-во СПбГУЭФ, 1999.
11. Владимиров В. А., Воробьев Ю. Л., Салов С. С. Управление риском: Риск. Устойчивоеразвитие. Синергетика. — М.: Наука, 2000.
12. Грачева М.В. Анализ проектных рисков: Учеб, пособие, — М.: ЗАО “Финстатинформ”, 1999.
13. Дубров А. М., Лагоша Б. А., Хрусталева Е. Ю., Барановская Т. П. Моделирование рискованных ситуаций в экономике и бизнесе. — М.: Финансы и статистика, 1999.
14. Попова Г. В. Руководитель в условиях экономического риска и кризиса. — Воронеж: Изд-во Воронеж, гос. ун-та, 1997.
15. Трифонов С. В. Модель оптимизации цены риска при обосновании реальных инвестиций. — СПб.: Изд-во СПбГУЭФ, 1999.

5.2 Додаткова

16. Волков И. М., Грачева М. В. Проектный анализ. — М.: ЮНИТИ; Банки и биржи, 1998.
17. Козлов А. П. Формы управления рисками в деятельности предприятия. — М.: Диалог-МГУ, 1999.
18. Колосов А. В., Агапов Н. Н. Эколого-экономические оценки риска и устойчивого развития. — М.: Изд-во Рос, экон. наук, 1999.
19. Лапуста М. Г., Шаршукова Л. Г. Риски в предпринимательской деятельности. — М.: ИНФРА-М, 1998.
20. Миэринь Л. А. Основы рискологии: Учеб, пособие. — СПб.: Изд-во СПбГУЭФ, 1998.

21. Моделирование экономической динамики: риск, оптимизация, прогнозирование / Под ред. Р. М. Нижегородцева. - М.:Диалог- МГУ, 1997.
22. Рогов М. А. Риск-менеджмент.— М.:Финансы и статистика, 2001.
23. Савинская Н. А., Багиева М. Н. Риски и устойчивость предприятий. — СПб.: Изд-во СПбГУЭФ, 1999.