

ОДодаток 8
ЗАТВЕРДЖЕНО
Наказ ректора ДВНЗ «ПДТУ»
від 30 серпня 2019 № 147-05
Форма № ПДТУ-3.04

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ

ДЕРЖАВНИЙ ВИЩИЙ НАВЧАЛЬНИЙ ЗАКЛАД
«ПРИАЗОВСЬКИЙ ДЕРЖАВНИЙ ТЕХНІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ»

Прогноз ризиків та кризи, методи та інструменти аналізу та скорочення
(назва навчальної дисципліни)

ПРОГРАМА
навчальної дисципліни

для здобуття освітнього ступеня магістра
(назва ступеня)

за спеціальністю 275 «Транспортні технології»
(шифр і назва спеціальності)
спеціалізацією 275.03 «Транспортні технології (на автомобільному
транспорті)»,
(шифр і назва)
освітньою програмою «Організація перевезень і управління на
автомобільному транспорті», «Транспортні системи»
(назва)



This project has been funded with support from the European Commission. This presentation reflects the views only of the author, and the Commission cannot be held responsible for any use which may be made of the information contained there in.

2020 рік

РОЗРОБНИКИ ПРОГРАМИ:

Воропай Валерія Сергіївна, к.т.н., доцент

Програма затверджена на засіданні кафедри транспортних технологій підприємств
“14” травня 2020 року, протокол № 16

Завідувач кафедри _____ (Г. В. Маслак)
(підпис) (прізвище та ініціали)

Схвалено методичною комісією факультету транспортних технологій
“26” червня 2020 року, протокол № 11

Голова _____ (Н. С. Захаренко)
(підпис) (прізвище та ініціали)

Затверджено вченою радою ДВНЗ «ПДТУ»

“02” липня 2020 року, протокол № 11

© ДВНЗ «ПДТУ», 2020 рік

© _____, 2021 рік

ВСТУП

Програма вивчення навчальної дисципліни «Прогноз ризиків та кризи, методи та інструменти аналізу та скорочення» складена відповідно до освітньо-професійної програми підготовки здобувачів за другим (магістерським) рівнем вищої освіти за спеціальністю (спеціалізацією) 275 «Транспортні технології», 275.03 «Транспортні технології (на автомобільному транспорті)», освітньою програмою «Організація перевезень і управління на автомобільному транспорті», «Транспортні системи».

Предметом вивчення навчальної дисципліни є розкриття теоретичного та практичного матеріалу циклу підготовки магістрів спеціальності 275 «Транспортні технології» і представляє один з важливих розділів підготовки, у якому розглянуті загальні принципи і закономірності визначення ризиків, методи та засоби прогнозування в умовах кризи негативних їх впливів на процеси транспортно-логістичних систем.

Міждисциплінарні зв'язки.

Попередні дисципліни – «Основи менеджменту», «Теорія ймовірностей та математична статистика», «Загальний курс транспорту», «Транспортна логістика», «Основи економіки транспорту», «Основи теорії транспортних процесів і систем», «Логістика автомобільного транспорту», «Моделювання транспортних процесів», «Менеджмент і маркетинг в автосервісі», «Логістичні центри», «Ризик і кризисне проектування систем міжнародних перевезень», «Логістичне управління міжнародними перевезеннями», «Міська логістика», «Економічна теорія», «Організація міжнародних автомобільних перевезень».

Забезпечувані дисципліни - «Основи менеджменту», «Теорія ймовірностей та математична статистика», «Економічна теорія».

Програма навчальної дисципліни складається з таких змістових модулів:

1. Концептуальні основи та положення теорії про ризики та прогнозування. Ризики та їх прогнозування в у транспортно-логістичних системах в умовах кризи.
2. Методи та засоби прогнозування ризиків.

1. Мета та завдання навчальної дисципліни

1.1. Метою викладання навчальної дисципліни «Прогноз ризиків та кризи, методи та інструменти аналізу та скорочення» - розкриття закономірностей процесів ризик-менеджменту у транспортно-логістичних системах, формування у студентів системи наукових і професійних знань у сфері процедур визначення можливих ризиків, методів та засобів їх прогнозування та скорочення.

1.2. Основними завданнями вивчення дисципліни “Прогноз ризиків та кризи, методи та інструменти аналізу та скорочення” є

- набуття студентами глибоких теоретичних знань з питань концепції, стратегії і тактики прогнозування ризиків;
- оволодіння студентами методичним інструментарієм аналізу кризових ситуацій;
- оволодіння навичками критичного мислення і розробки пропозицій щодо мінімізації наслідків кризових ситуацій у транспортно-логістичних системах;
- чітке осмислення студентами ланцюгу можливості виникнення та запобігання ризиків від етапу прогнозування до методів скорочення;
- набуття студентами глибоких теоретичних знань з ідентифікації ризиків та відповідних стратегій їх запобігання.

1.3. Перелік компетенції:

здатність до критичного мислення, узагальнення та аналізу подій; задання цілей та обрання засобів для їх досягнення; здатність обирати інструменти для обробки даних, пов'язаних з виникненням ризиків; здатність використовувати для рішення аналітичних та дослідницьких задач сучасні технічні засоби та інформаційні технології; здатність критично оцінювати варіанти управлінських рішень, що пропонуються, та розробити і обґрунтувати пропозиції за їх вдосконаленням.

Згідно з вимогами освітньо-професійної програми студенти повинні:

знати:

- що являє собою ризик-менеджмент у сфері транспортного обслуговування логістичних систем;
- вплив ризиків на діяльність транспортно-логістичних систем;
- методи оцінки та управління ризиками в рамках сучасної парадигми управління ризиками;

вміти:

- користуватися математичними моделями, які адекватно враховують ризикові ситуації;
- будувати модель, яка дозволяє прийняти оптимальне рішення відносно ризиків;
- приймати заходи моделювання ризикових ситуацій як в наукових дослідженнях так і на практиці.

На вивчення навчальної дисципліни відводиться 108 години 4 кредитів ЄКТС.

2. Інформаційний обсяг навчальної дисципліни

Змістовий модуль 1.

1. Концептуальні основи теорії прогнозування ризиків.

Визначення ризику. Імовірність втрати. Ризик та небезпека. Індивідуальні та комерційні ризики. Вплив ризику на економічні процеси.

Роль та місце ризику у логістичній діяльності. Фактори, які визначають ризики у логістичній діяльності. Основи неокласичної теорії ризиків. Фактори, які формують профіль ризиків на підприємстві.

Техніки запобігання ризику.

2. Ризик-аналіз основних видів діяльності підприємства .

Загальна характеристика логістичної та економічної діяльності підприємства. Ризики виробничої діяльності підприємства.

Фінансові ризики підприємства та їх вплив на підприємництво.

Комерційні та посередницькі ризики та їх вплив на діяльність підприємства.

3. Стратегічні основи управління ризиками на підприємстві.

Інтегрований підхід до структури служби ризик-менеджменту фірми.

Концептуальні та стратегічні напрямки зниження ризику.

Сучасні вимоги до управління ризиків.

Контроль та звітність процесу управління ризиками.

4. Прийняття рішень в умовах соціально-економічного та технічного ризиків транспортно-логістичних систем.

Сутність ризику та причини його виникнення. Класифікація видів ризику. Ступінь зв'язку з логістичною діяльністю.

Належність до країни функціонування суб'єкта логістичної діяльності.

Принципи аналізу та оцінки ризику. Якісний аналіз ризику. Особливості кількісного аналізу ризику. Методи аналізу ризику.

Формальний опис ризику. Будування функції ризику.

Прийняття рішень при наявності ризика.

5. Ризик у транспортно-логістичних системах.

Моделювання логістичних процесів в умовах ризику.

Керування якістю послуг в умовах кризи. Управління ризиками на етапі прогнозування соціально-економічного розвитку транспортно-логістичної системи. Формування управлінських рішень.

Внутрішні та зовнішні ризики.

Алгоритм процесу управління ризиками.

Змістовий модуль 2.

6. Аналіз кризи.

Методологія аналізу кризи.

Елементарний список показників кризи.

Елементарні, підсистеми та системи у методології аналізу кризи.

Функції аналізу кризи.

Операції та підтримка у процесі аналізу кризи.

7. Fault tree analysis (FTA).

Fault tree символи та логіка. Виділення компонентів. Fault tree розрахунки. Приклади Fault tree конструювання деяких систем. Загальні помилки у Fault tree.

8. Математичні методи прогнозування у плануванні та управлінні.

Планування та загальні поняття. Деякі математичні методи, які використовуються у економічному плануванні. Метод диференційного обчислювання. Логарифмічний метод. Метод подрібнення прирощення факторів. Інтегральний метод оцінки факторних впливів на результуючий показник, що планується.

Прогнозування в управлінні та плануванні. Методика прогнозування одномірних рядків.

9. Безпека як одна з основ ефективного менеджменту у транспортно-логістичних системах.

Безпека у життєвому циклі транспортно-логістичної системи. Тренінги щодо можливості запобігання використанню невдалих додатків у безпеці у транспортно-логістичних системах.

Розвиток найнадійніших систем безпеки у менеджменті транспортно-логістичних систем. Елементи систем безпеки у менеджменті транспортно-логістичних систем. Управління безпекою. Організація безпеки. Програма безпеки системи. Культура безпеки. Перевірка та діагностика безпеки системи.

3. Рекомендована література

Базова

1. Rejda, George E. Principles of risk management and insurance / George E., Rejda, Michael J. McNamara. – Twelfth edition. – 2014. – P. 702.

2. Балдин, К. В., Воробьев, С. Н. Риск-менеджмент: Учебное пособие. — М.: Гардарики, 2005. - 285 с: ил.
3. Nicholas J. Bahr. Safety system engineering and risk assessment: A practical approach. Second edition. 2015 – P. 396.
4. Шапкин, А. С. Математические методы и модели исследования операций: учебник для вузов / А.С. Шапкин, Н.П. Мазаева. - 4-е изд. - М. : Дашков и К, 2007. - 396 с.

Допоміжна

5. Стафиевская, М. В. Аналитический подход, позволяющий на основе статистических методов выявить степень воздействия на деятельность предприятия различных составляющих хозяйственных рисков // Экономика и предпринимательство. 2016. № 9 (74). С. 1121–1123.
6. Никитин, С. И., Никифоров, Е. С., Фельдшеров, К. В. Моделирование логистических процессов в условиях риска // Теория и практика сервиса: экономика, социальная сфера, технологии. 2013. №4 (42). С. 191-200.
7. M. Lim, A. Bassamboo, S. Chopra and M.S. Daskin. “Flexibility and Fragility: Use of Chaining Strategies in the Presence of Disruption Risks,” Northwestern University research report, 2010.
8. Бутакова, М. М. Экономическое прогнозирование. Методы и приемы практических расчетов: учебное пособие. – М.: КноРус, 2010.

Інформаційні ресурси

9. <http://www.eco.uc3m.es/~jgonzalo/teaching/timeseriesMA.html>
 10. <http://www.sra.org/>
4. **Форма підсумкового контролю успішності навчання:** іспит.
 5. **Засоби діагностики успішності навчання:** усне та письмове опитування, поточна і модульна контрольна робота, захист практичних робіт, оцінка присутності та активності на лекціях.