

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ХАРКІВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ ЕКОНОМІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ІМЕНІ СЕМЕНА КУЗНЕЦЯ

ЗАТВЕРДЖЕНО

на засіданні кафедри
менеджменту, логістики
та інновацій
Протокол № 2 від 31.08.2023 р.



ПОГОДЖЕНО

Проректор з навчально-методичної роботи

Каріна НЕМАШКАЛО

УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ В ЛОГІСТИЦІ

робоча програма навчальної дисципліни (РПНД)

Галузь знань **07 «Управління та адміністрування»**
Спеціальність **073 «Менеджмент»**
Освітній рівень **перший (бакалаврський)**
Освітня програма **«Логістика»**

Статус дисципліни **вибіркова**
Мова викладання, навчання та оцінювання **українська**

Розробник:
к.е.н., доцент

Підписано КЕП

Лідія МАЖНИК

Завідувач кафедри
менеджменту, логістики та
інновацій


Олена ЯСТРЕМСЬКА

Гарант програми


Тетяна КОЛОДІЗЄВА

Харків
2023

ВСТУП

Управління ризиками в логістиці – це новий напрям в теорії управління діяльністю підприємства.

Навчальна дисципліна «Управління ризиками в логістиці» належить до вибіркового освітнього компонента освітньої програми «Логістика». Робочу програму навчальної дисципліни розроблено у відповідності до вимог галузевого стандарту вищої освіти на базі освітньо-професійної програми підготовки бакалавра.

Мета навчальної дисципліни – викладення здобувачам необхідних теоретичних основ, методичних підходів і практичних навичок щодо аналізу, оцінювання та моделювання ризиків та управління ним під час прийняття рішень в логістичних системах.

Завдання – оволодіння навичками управління ризиками для забезпечення ефективного управління логістичною системою.

Об'єктом навчальної дисципліни є логістичні ризики, оцінка ризиків, управління ризиками. Предмет навчальної дисципліни – логістичні ризики, що виникають у процесі підприємницької діяльності між суб'єктами, особливості взаємодії в процесі оцінки та управління ризиками.

Результати навчання та компетентності, які формує навчальна дисципліна визначено в табл. 1.

Таблиця 1

Результати навчання та компетентності, які формує навчальна дисципліна

Результати навчання	Компетентності, якими повинен оволодіти здобувач вищої освіти
PH 5	СК 8
PH 11	СК 18
PH 16	СК 11
PH 18	СК 17
PH 19	СК 18
PH 22	СК 20

де, СК 8. Здатність планувати діяльність організації та управляти часом.

СК11. Здатність створювати та організовувати ефективні комунікації в процесі управління.

СК.17 Здатність здійснювати організаційне, технологічне, технічне та інформаційне забезпечення базових функцій логістики. Здатність здійснювати управління логістичною діяльністю підприємств у сферах виробництва, запасів, складування, закупівель, збуту, транспортування та вантажоперероблення.

СК.18 Здатність до розроблення системи логістичного обслуговування, стратегії логістичного сервісу Здатність організовувати логістичне обслуговування споживачів та управляти замовленнями в системі логістичного обслуговування. Здатність до формування системи логістичного сервісу та системи якості обслуговування.

СК20. Здатність ефективно аналізувати та інтегрувати логістичну концепцію у міжнародну діяльність, аналізувати концептуальні основи та визначати основні категорії міжнародної логістики, застосовувати оптимізаційний фактор при поставці товарів у

міжнародному сполученні Здатність до вибору оптимального виду транспорту у міжнародному сполученні, до прийняття ефективних рішень в процесі здійснення міжнародної логістичної діяльності.

PH5. Описувати зміст функціональних сфер діяльності організації.

PH11. Демонструвати навички аналізу ситуації та здійснення комунікації у різних сферах діяльності організації.

PH16. Демонструвати навички самостійної роботи, гнучкого мислення, відкритості до нових знань, бути критичним і самокритичним.

PH18. Використовувати принципи та методи логістики в загальній системі менеджменту підприємства для зниження витрат та оптимізації логістичних потоків і процесів організацій.

PH19. Застосовувати логістичний підхід до управління ресурсами організацій та забезпечувати підвищення їх конкурентоспроможності. Демонструвати навички оптимізації організаційно-технологічних аспектів основних функцій логістики з використанням комунікативно-інформаційного забезпечення.

PH22. Здатність застосовувати оптимізаційний фактор при поставці товарів у міжнародному сполученні, обирати оптимальний виду транспорту у міжнародному сполученні. Проводити аналіз міжнародних договорів, аналізувати ризики в міжнародній логістиці.

ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Зміст навчальної дисципліни

Змістовий модуль 1. Сутність логістичних ризиків

Тема 1. Економічна сутність ризику в логістиці

1.1. Визначення поняття «ризик».

Сутність ризиків в логістиці. Поняття "ризик". Визначення поняття «ризик» різними авторами.

1.2. Класифікація ризиків.

Класифікація ризиків за різними ознаками. Операційний ризик. Ринковий ризик. Бізнес-ризик. Кредитний ризик. Припустимий ризик. Критичний ризик. Катастрофічний ризик. Підприємницький ризик.

1.3. Ризик, надійність і страхування в логістичних системах.

Особливості ризиків в логістичній системі. Сутність ризику та його надійність і страхування в логістичних системах.

Тема 2. Методи оцінки ризиків

2.1. Вимір ризику.

Сутність визначення «вимір ризику». Перелік та послідовність процесу виміру. Особливості виміру ризику щодо суб'єктів господарювання.

2.2. Оцінка ймовірності несприятливих подій.

Оцінка ймовірності несприятливих подій. Методи оцінки ймовірності настання несприятливих подій: метод побудови дерев подій, метод «події – наслідки», метод індексів небезпеки. Індекс Дау.

2.3. Оцінка збитку.

Оцінка збитку. Прямі збитки. Непрямі збитки. Збиток майна. Втрати прибутку. Втрати робочих днів. Витрати на розслідування події. Упущена вигода. Штрафи та претензії через недопоставку продукції. Юридичні витрати. Витрати на оплату медичних витрат. Виплати компенсації персоналу. Перепідготовка персоналу. Втрати іміджу.

Змістовий модуль 2. Управління ризиками та їх страхування

Тема 3. Управління ризиками

3.1. Загальна схема процесу управління ризиками.

Загальна схема управління ризиками. Процес ризик-менеджменту. Статистичні методи оцінки рівня ризику. Експертні методи оцінки рівня ризику.

3.2. Організація управління ризиками на підприємстві.

Організація управління ризиками на підприємстві. Основні організаційні аспекти створення структури з ризиком. Положення з управління ризиком. Посібник з управління ризиком.

3.3. Методи управління ризиками та їх вибір.

Методи управління ризиками. Уникнення ризиків чи відмова від них. Прийняття ризиків на себе. Запобігання збиткам. Зменшення розміру збитків. Страхування. Самострахування. Передачі ризиків (відмінний від страхування). Вибір методів управління ризиками для різних факторів ризику.

Тема 4. Страхування ризиків

4.1. Основні поняття, види та методи страхування.

Сутність страхування. Основні поняття страхування. Страхові ризики. Види страхування. Методи страхування. Пропорційне страхування. Непропорційне страхування.

4.2. Страхування засобів наземного і водного транспорту.

Страхування засобів наземного та водного транспорту. Страхування каско. Страхування автомобільного транспорту. Страхування водіїв транспортних засобів і пасажирів від нещасних випадків. Страхування залізничного рухливого складу. Морське страхування судів, групи збитків судновласника.

4.3. Страхування засобів повітряного транспорту.

Страхування засобів повітряного транспорту. Умови авіаційного страхування. Специфіка авіаційного страхування. Поліс зі страхування повітряного транспорту.

4.4. Страхування вантажів.

Страхування вантажів. Договір страхування вантажів. Страхування фрахту.

4.5. Страхування відповідальності перевізника.

Страхування відповідальності перевізника. Договір страхування відповідальності автоперевізника. Порядок страхової виплати майнової претензії. Страхування відповідальності автоперевізника. Страхування

відповідальності власників аеропортів. Ризики при страхуванні відповідальності судновласників.

Перелік практичних (семінарських) завдань та лабораторних робіт за навчальною дисципліною наведено в табл. 2.

Таблиця 2

Перелік практичних (семінарських) завдань та лабораторних робіт

Назва теми та / або завдання	Зміст
Тема 1. Економічна сутність ризику в логістиці	Практичні (семінарські) завдання: 1.1. Визначення поняття «ризик» 1.2. Класифікація ризиків 1.3. Ризик, надійність і страхування в логістичних системах Лабораторна робота 1. Ризик у логістиці та його страхування в системі
Тема 2. Методи оцінки ризиків	Практичні (семінарські) завдання: 2.1. Вимір ризику 2.2. Оцінка ймовірності несприятливих подій 2.3. Оцінка збитку Лабораторна робота 2. Оцінювання ризику та збитку
Тема 3. Управління ризиками	Практичні (семінарські) завдання: 3.1. Загальна схема процесу управління ризиками 3.2. Організація управління ризиками на підприємстві 3.3. Методи управління ризиками та їх вибір Лабораторна робота 3. Організація процесу та вибір методів управління ризиками
Тема 4. Страхування ризиків	Практичні (семінарські) завдання: 4.1. Основні поняття, види та методи страхування 4.2. Страхування засобів наземного та водного транспорту 4.3. Страхування засобів повітряного транспорту 4.4. Страхування вантажів 4.5. Страхування відповідальності перевізника Лабораторна робота 4. Страхування ризиків

Перелік самостійної роботи за навчальною дисципліною наведено в табл. 3.

Таблиця 3

Перелік самостійної роботи

Назва теми та / або завдання	Зміст
Тема 1. Економічна сутність ризику в логістиці	1. Підходи до визначення поняття «ризик». 2. Базова класифікація ризиків 3. Особливості логістичних ризиків. 4. Взаємозв'язок управління та страхування в логістичних системах. 5. Основні елементи ризику в логістичних системах
Тема 2. Методи оцінки ризиків	1. Інструменти статистичного методу розрахунку ризику.

	2. Аналогові методи оцінки рівня ризику. 3. Прямі та непрямі збитки. 4. Інтегральна оцінка ризику.
Тема 3. Управління ризиками	1. Основні етапи процесу управління ризиком. 2. Документація для управління ризиками. 3. Програма управління ризиками на підприємстві: процедура складання
Тема 4. Страхування ризиків	1. Взаємозв'язок системи страхування вантажів та відповідальності перевізника. 2. Правила транспортного страхування вантажів. 3. Претензії по страховому полісі експедитора й порядок розгляду претензії

Кількість годин лекційних, практичних (семінарських) та лабораторних занять та годин самостійної роботи наведено в робочому плані (технологічній карті) з навчальної дисципліни.

МЕТОДИ НАВЧАННЯ

У процесі викладання навчальної дисципліни для набуття визначених результатів навчання, активізації освітнього процесу передбачено застосування таких методів навчання, як:

Словесні (лекція (Тема 1, 4), проблемна лекція (Тема 2), лекція провокація (Тема 3)).

Наочні (демонстрація (Тема 1 – 4)).

Практичні (практична та лабораторна робота (Тема 1 – 4), есе (Тема 1), кейс-метод (Тема 3, 4)).

ФОРМИ ТА МЕТОДИ ОЦІНЮВАННЯ

Університет використовує 100 бальну накопичувальну систему оцінювання результатів навчання здобувачів вищої освіти.

Поточний контроль здійснюється під час проведення лекційних, практичних, лабораторних та семінарських занять і має на меті перевірку рівня підготовленості здобувача вищої освіти до виконання конкретної роботи і оцінюється сумою набраних балів:

– для дисциплін з формою семестрового контролю екзамен (іспит): максимальна сума – 60 балів; мінімальна сума, що дозволяє здобувачу вищої освіти скласти екзамен (іспит) – 35 балів.

Підсумковий контроль включає семестровий контроль та атестацію здобувача вищої освіти.

Семестровий контроль проводиться у формах семестрового екзамену (іспиту). Складання семестрового екзамену (іспиту) здійснюється під час екзаменаційної сесії.

Максимальна сума балів, яку може отримати здобувач вищої освіти під час екзамену (іспиту) – 40 балів. Мінімальна сума, за якою екзамен (іспит) вважається складеним – 25 балів.

Підсумкова оцінка за навчальною дисципліною визначається:

– для дисциплін з формою семестрового контролю екзамен (іспит) – сумуванням балів за поточний та підсумковий контроль.

Під час викладання навчальної дисципліни використовуються наступні контрольні заходи:

Поточний контроль: Індивідуальні навчально-дослідні завдання (25 балів), письмова контрольна робота (10 балів), колоквиум (20 балів), есе (5 балів).

Семестровий контроль: Екзамен (40 балів).

Більш детальну інформацію щодо системи оцінювання наведено в робочому плані (технологічній карті) з навчальної дисципліни.

Приклад екзаменаційного білета

Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця

Перший (бакалавр) рівень вищої освіти

Спеціальність «Менеджмент»

Освітня програма «Логістика»

Навчальна дисципліна «Управління ризиками в логістиці»

ЕКЗАМЕНАЦІЙНИЙ БІЛЕТ №1

Завдання 1 (тест), 20 балів

1. Сучасне поняття «ризик»:

А. Використовується для позначення можливого матеріального збитку;

Б. Пов'язаний як з можливими матеріальними втратами, так і з можливим прибутком;

В. Ідентифіковано лише з отриманими матеріальними збитками.

2. Зміна курсу валют, кон'юнктури ринку, податкового законодавства є факторами:

А. Чисті ризики;

Б. Спекулятивні ризики.

3. Непрямими втратами прибутку, пов'язаними з впливом факторів ризику, є:

А. Збитки від невиконання операції, неукладення договору, нереалізації товару;

Б. Витрати на організацію та проведення діяльності з управління ризиками;

В. Можливі збитки, пов'язані з господарськими операціями.

4. Величина коефіцієнта ризику в діапазоні від 0,3 до 0,6 характеризує:

- А. Мінімальний рівень ризику;
- Б. Прийнятний рівень ризику;
- В. Високий рівень ризику;
- Г. Неприйнятний рівень ризику.

5. Критерій прийняття рішення в умовах невизначеності, заснований на виборі максимального середнього значення, називається:

- А. Критерій Лапласа;
- Б. Критерій Вальда;
- В. Критерій Гурвіца;
- Г. Критерій Севіджа.

6. У розробленій системі управління ризиками тактика управління ризиками реалізується на основі ...

А. Системи організаційної документації – постанови, інструкції, методичні та технологічні матеріали, що забезпечують ефективну реалізацію обраної альтернативи ризику;

Б. Розроблена та затверджена концепція управління ризиками;

В. Ситуаційний підхід, при якому оцінка ризику та реалізація ризикових заходів відбувається відповідно до ризикової ситуації з урахуванням конкретних факторів та умов.

7. Формування системи страхових запасів і резервів здійснюється за методом:

- А. Диверсифікація;
- Б. Обмеження;
- В. Компенсація;
- Г. Страхування.

8. Ризики, пов'язані з купівельною спроможністю грошей, включають:

А. Ризики ліквідності, валютний, дефляційний, інфляційний ризики;

Б. Ризик зниження прибутковості, ризик прямих фінансових втрат, ризик упущеної вигоди;

В. Інвестиційні та фінансові ризики.

9. Експертними методами прийняття ризикових рішень є:

А. Якісні оцінки спеціалістів, що дозволяють найбільш повно описати ситуацію прийняття ризикованого рішення та розглянути варіанти, які важко формалізувати;

Б. Комплекс логіко-математичних процедур, спрямованих на отримання інформації від експертів, її аналіз та узагальнення з метою вибору раціональних рішень.

10. Концепція прийняттого ризику передбачає ...

А. Необхідність вибору управлінських рішень відповідно до суб'єктивної оцінки менеджером рівня ризику;

Б. Здатність йти на ризик, якщо його величина становить не більше 10%;

В. Визначення початкового, розрахункового та кінцевого рівня ризику та постійне впровадження заходів з управління ризиком на цій основі.

Завдання 2 (діагностичне), 8 балів

Використовуючи дані табл. 1, визначити рівень рентабельності активів у плановому періоді, необхідно розрахувати варіацію, дисперсію, середньоквадратичне квадратичне відхилення.

Таблиця 1

Економічна рентабельність активів підприємства за 2013 – 2022 роки, %

Рентабельність підприємства	активів	Роки									
		2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022
		3	11	11	1	9	11	11	4	8	13

Завдання 3 (евристичний рівень), 12 балів

Харківська компанія ТОВ «Т Престиж» є виробником кондитерських виробів. Одним із продуктів, які пропонує компанія, є торти із заварним кремом. Компанія продає 15, 16 і 10 ящиків протягом п'яти днів. Від продажу кожного ящика підприємство отримує 450 грн. прибуток Як відомо, торти із заварним кремом мають дуже короткий термін зберігання. Тому, якщо коробка не продається протягом 5 днів, її необхідно знищити. Виробництво однієї коробки тістечок обходиться підприємству в 108 грн. Імовірності продажу 15, 16 і 10 коробок протягом тижня дорівнюють відповідно 0,45; 0,25; 0,3. Надати рекомендації щодо обсягів виробництва тортів керівнику підприємства. Побудуйте матрицю гри з природою (ТОВ — гравець з природою, а природа — торгове середовище). Обчисліть середній очікуваний прибуток виробника, використовуючи ймовірності природного стану. На підставі розрахунків зробіть висновки.

Затверджено на засіданні кафедри менеджменту, логістики та інновацій № _____ від «___» _____ 20__ р.

Екзаменатор к.е.н., доц.

Лідія МАЖНИК

Зав. кафедрою д.е.н., проф.

Олена ЯСТРЕМСЬКА

КРИТЕРІЇ ОЦІНЮВАННЯ

Підсумкові оцінки за іспит складаються із суми оцінок за виконання всіх завдань, округленої до цілого числа згідно з правилами математики.

Алгоритм вирішення кожного завдання включає окремі етапи, що відрізняються за складністю, трудомісткістю та важливістю для вирішення завдання. Тому окремі завдання та етапи їх вирішення оцінюються окремо один від одного наступним чином:

кожна правильна відповідь на тестове запитання оцінюється 2 балами.

Максимальна кількість балів за правильне вирішення тестових завдань дорівнює 20 балам. Максимальна кількість балів за діагностичне завдання – 8 балів, за евристичне завдання – 12 балів.

Для оцінки рівня відповідності здобувачів розв'язанню практичних завдань використовуються такі критерії:

Діагностичне завдання. Оцінка 8–7 бали виставляється за правильне виконання практичного завдання за типовим алгоритмом. Оцінка 6–4 балів виставляється, якщо завдання виконано повністю, але допущені неточності в розрахунках і оформленні; формулювання термінів, категорій, невеликі арифметичні помилки в розрахунках при прийнятті рішення; або за умови, що завдання виконано належним чином не менше ніж на 70%. Оцінка 3–1 бали виставляється при виконанні завдання не менше ніж на 50 % за умови правильного виконання; або не менше ніж на 70% з урахуванням помилок у розрахунках та реєстрації.

Евристичне завдання. За повне засвоєння програмового матеріалу та вміння орієнтуватися в ньому, використання додаткового матеріалу, прояви творчого характеру виставляється оцінка 12–10 балів. Здобувач демонструє свідоме застосування знань для вирішення практичних ситуацій. При виконанні евристичного завдання здобувач повинен зробити правильні висновки щодо запропонованої виробничої ситуації та сформулювати власну рекомендацію щодо вдосконалення проблеми. Оформлення виконаного завдання має бути акуратним.

Оцінка 9–7 балів виставляється за повне виконання завдання, але відсутність творчого підходу та демонстрації знання додаткового матеріалу. Загалом завдання виконано методично правильно та оформлено акуратно.

Оцінка 6–2 бали виставляється за часткове вміння застосовувати теоретичні знання для вирішення практичних задач; за умови, що завдання виконано частково, а учень під час відповіді продемонстрував розуміння основних положень навчального матеріалу.

РЕКОМЕНДОВАНА ЛІТЕРАТУРА

Основна

1. Балуєва О. В. Управління ризиками в логістиці: навчальний посібник / О. В. Балуєва, В. М. Гончаров, Р. Р. Ларіна. – Львів: вид-во Магнолія 2006, 2021. – 254 с.

2. Боровик М. В. Ризик-менеджмент / М. В. Боровик ; Харків. нац. ун-т міськ. госп-ва ім. О. М. Бекетова. – Харків :ХНУМГ ім. О. М. Бекетова, 2018. – 65 с.

3. Мажник Л.О. Логістика невиробничої сфери: Управління ризиками в логістиці: навчальний посібник / Л. О. Мажник, В. О. Письмак. – Харків : ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2016. – 164 с. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <http://www.repository.hneu.edu.ua/jspui/handle/123456789/14813>.

Додаткова

4. Improvement of efficiency of enterprises operating in the services sector on the basis of logistics concepts / V. Pysmak, L. Mazhnyk // Економічний часопис-XXI, 2016. – 156 вип. – 101–104 р.

5. Pysmak V. Innovative development of the management potential at a modern enterprise / V. Pysmak, L. Mazhnyk, T. Sigaieva // Economics of Development, 2021. 20 (1), 46–55. – Режим доступу: <http://repository.hneu.edu.ua/handle/123456789/27163>.

6. Демченко Г. В. Ризик-менеджмент : конспект лекцій для студентів спеціальності 073 «Менеджмент» першого бакалаврського рівня. – Харків: ХНЕУ ім.С.Кузнеця, 2021. – 65 с. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <http://repository.hneu.edu.ua/handle/123456789/25441>.

7. Жовніренко Г. О. Економічні ризики : навч. посіб. – Донецьк : ДонІЗТ, 2011. – 142 с.

8. Коюда В. О. Ризик-менеджмент. Методичні рекомендації до самостійної роботи студентів спеціальності 073 «Менеджмент» першого (бакалаврського) рівня. – Харків : ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2017. – 48 с. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: http://www.repository.hneu.edu.ua/bitstream/123456789/19808/1/2017-%D0%9A%D0%BE%D1%8E%D0%B4%D0%B0_%D0%92_%D0%9E_%D0%9A%D0%BE%D1%81%D1%82%D1%96%D0%BD%D0%B0_%D0%9E_%D0%9C.PDF.

9. Самойленко В. В. Особливості формування системи управління ризиками на підприємстві – Київ : Гельветика. – 2022. – Т. 33 (72). – № 1. – С. 28–36. [Електронний ресурс] – Режим доступу: <http://repository.hneu.edu.ua/handle/123456789/27399>.

Інформаційні ресурси

10. ISO 31000:2018(en). Risk management – Guidelines. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <https://www.iso.org/obp/ui/#iso:std:iso:31000:ed-2:v1:en>.