



СИЛАБУС ДИСЦИПЛІНИ «РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТ»

Ступінь вищої освіти – Бакалавр
Спеціальність 073 «Менеджмент»
Освітня програма «Менеджмент»
Рік навчання 4, семестр 7
Форма навчання денна
Кількість кредитів ЄКТС 3
Мова викладання українська

Лектор дисципліни

Контактна інформація
лектора (e-mail)

Лайко Ольга Олександрівна, кандидат економічних наук,
старший викладач кафедри менеджменту та аграрної економіки
o.layko@ukr.net

ОПИС ДИСЦИПЛІНИ

Мета дисципліни «Ризик-менеджмент» – формування у студентів системи компетентностей, які необхідні для обґрунтування управлінських рішень з різним ступенем невизначеності та ризику у сучасних умовах трансформаційних перетворень. Вивчення теоретичних і методичних основ процесу прийняття управлінських рішень у професійній діяльності.

Завдання курсу - формування у студентів компетентностей щодо системи знань з теоретично-методичних основ розроблення та прийняття управлінських рішень; компетентностей щодо системи навичок застосування основних принципів обґрунтування різних видів управлінських рішень; здатності до опанування практичними економіко-математичними методами щодо розробки та прийняття управлінських рішень в умовах визначеності, невизначеності та ризику; здатності до оцінки ефективності прийнятих управлінських рішень

Навчальна дисципліна формує такі міждисциплінарні зв'язки: дисципліни, що передують: менеджмент, операційний менеджмент, менеджмент підприємств агропромислового виробництва; дисципліни, що забезпечуються: управління інноваціями, аграрна політика.

Вивчення навчальної дисципліни передбачає формування та розвиток у здобувачів вищої освіти компетентностей та програмних результатів навчання відповідно до освітньої програми «Менеджмент» спеціальності 073 «Менеджмент».

Інтегральна компетентність (ІК). Здатність розв'язувати складні спеціалізовані задачі та практичні проблеми, які характеризуються комплексністю і невизначеністю умов, у сфері менеджменту або у процесі навчання, що передбачає застосування теорій та методів соціальних та поведінкових наук.

Загальні компетентності (ЗК):

ЗК 4 Здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях.

ЗК 5 Знання та розуміння предметної області та розуміння професійної діяльності.

ЗК 12. Здатність генерувати нові ідеї (креативність).

Спеціальні (фахові) компетентності (СК):

СК 3. Здатність визначати перспективи розвитку організації.

СК 7. Здатність обирати та використовувати сучасний інструментарій менеджменту.

Програмні результати навчання (ПРН):

ПРН 4. Демонструвати навички виявлення проблем та обґрунтування управлінських рішень.

ПРН 8. Застосовувати методи менеджменту для забезпечення ефективності діяльності організації.

ПРН 19 Демонструвати здатність самостійного прийняття рішень, розробляти достатню кількість альтернативних варіантів, обирати оптимальні рішення та нести відповідальність за їх реалізацію.

СТРУКТУРА ДИЦИПЛІНИ

Тема	Години (лекції/ практичні)	Результати навчання	Завдання	Оці- нюва ння
Модуль 1. Теоретичні аспекти ризик-менеджменту				
Тема 1. Вступ до дисципліни «Ризик-менеджмент»	1/2	Ризик-менеджмент і менеджмент: їх взаємозв'язок. Визначення ризику і ризик-менеджменту. Актуальність вивчення курсу ризик-менеджменту. Еволюція ризик-менеджменту. Стратегічний (комплексний, інтегральний) і функціональний ризик-менеджмент. Ризик і підприємництво	Виконання практичного завдання, самостійної роботи	12
Тема 2. Класифікація ризиків і загальна схема ризик-менеджменту	1/2	Класифікація ризиків (для фінансових і нефінансових організацій). Основні і додаткові критерії класифікації та види ризиків. Загальна схема процесу управління ризиками. Управління ризиком і страхування. Показники ризику. Глобальні ризики. Ризики у міжнародному бізнесі. Світові карти ризиків.	Виконання самостійної роботи	12
Тема 3. Засади системного аналізу ризику.	1/4	Аналіз ризику, загальні принципи. Якісний аналіз ризику – деякі аспекти. Об'єктивні та суб'єктивні чинники, які впливають на ступінь ризику. Кількісний аналіз ризику. Методи кількісного аналізу ризику: статистичні, використання аналогів, експертні методи, аналіз доречності витрат.	Виконання практичного завдання, самостійної роботи	10

Тема 4. Методологічні засади й інструментарій кількісного оцінювання ступеня ризику	1/2	Загальні підходи до кількісного оцінювання ступеня ризику. Імовірність як один із підходів до оцінювання ступеня ризику. Інгрєдєнт економїчного показника. Об'єктивний і суб'єктивний методи вимїрювання ризику. Ризик в абсолютному виразї: математичне сподївання, дисперсія, середньоквадратичне відхилення. Ризик у відносному виразї: коефіцієнт ризику. Застосування нерівності Чебишева в оцінках ступеня ризику.	Підготовка доповідей, рефератів, презентацій до семінарського заняття. Виконання практичного завдання, самостійної роботи	12
Тема 5. Основні засади управління ризиком	1/2	Принципи управління ризиком. Основні способи управління економічним ризиком. Прийняття рішень з урахуванням ризику. Використання експерименту як чинника зниження ризику. Таблиця рішень. Структура та види запасів, резервів. Резервування грошових засобів та покриття випадкових затрат.	Виконання самостійної роботи	12
Тема 6. Ризик-менеджмент на підприємстві: його організація і потрібна документація	1/2	Схема реалізації програми ризик-менеджменту. Розробка та ухвалення схеми управління ризиком. Участь вищого керівництва в ризик-менеджменті. Затвердження стратегії управління ризиком. Установлення відповідальності за впровадження ризик-менеджменту в компанії. Штат. Комунікації і навчання. Упровадження культури ризик-менеджменту за допомогою системи управління кадрами. Моніторинг процесу ризик-менеджменту.	Виконання самостійної роботи	12
Тест до модуля 1				30
Разом за модулем 1 змістовим				100
Модуль 2. Прикладні аспекти ризик-менеджменту				
Тема 7. Операційний ризик-менеджмент	1/4	Ризик-менеджмент на виробництві (операційний). Особливості виявлення операційних ризиків. Опитні	Виконання самостійної роботи	10

		листи і їх структура. Метод структурних діаграм. Карти потоків. Пряма інспекція. Аналіз фінансової й управлінської звітності. Особливості оцінки операційного ризику. Методи оцінки ризику. Методи оцінки ймовірності несприятливих подій (метод побудови дерев подій, метод події – наслідки, метод дерев відмов, метод індексів небезпеки). Методи оцінки збитків.		
Тема 8. Ризик-менеджмент у сфері фінансів	1/4	Фінансові ризики і важливість їх вивчення. Фінанси, фінансова система та її функції, фінансові потоки. Фінансові рішення та фінансовий менеджмент. Фінансова система і ризики. Фінансові ризики: суть і характеристики. Класифікація фінансових ризиків. Ризик-менеджмент у фінансовій сфері та його принципи. Методичний інструментарій оцінки рівня фінансового ризику. Управління фінансовими ризиками: суть і етапи. Фактори, що впливають на рівень фінансових ризиків. Методи управління фінансовими ризиками	Виконання самостійної роботи	10
Тема 9. Ризик-менеджмент у сфері маркетингу	1/2	Ризик-менеджмент і маркетинг: сфери перетинання. Ризик-менеджмент під час проведення маркетингових досліджень. Ризики споживача (сприймані ризики): визначення і дискусії щодо них. Моделі вимірювання сприйманого ризику. Маркетингове дослідження сприйманого ризику.	Підготовка доповідей, рефератів, презентацій до семінарського заняття. Виконання практичного завдання, самостійної роботи	10
Тема 10. Ризик-менеджмент у зовнішньоекономічній діяльності	1/2	Зовнішньоекономічні ризики та їх види. Ризики країни. Ризик вибору партнера. Ризики зовнішньоекономічного контракту. Практичні аспекти аналізу і розрахунку ризиків на етапі підготовки зовнішньоекономічної операції	Виконання самостійної роботи	10

Тема 11. Кількісний аналіз проектних ризиків і можливості комп'ютерного моделювання	2/2	Використання Excel для ризик-менеджменту. Методи аналізу ризиків інвестиційних проектів (метод коректування норми дисконту, метод достовірних еквівалентів, аналіз чутливості критеріїв ефективності, метод сценаріїв, аналіз імовірнісного розподілу потоків платежів, дерево рішень). Імітаційне моделювання інвестиційних ризиків. Математична модель маркетингового проекту.	Виконання самостійної роботи	10
Тема 12. Використання спеціалізованого програмного забезпечення у сфері ризик- менеджменту	2/2	Можливість і потреба використання спеціалізованого програмного забезпечення (ПЗ) в ризик-менеджменті. Огляд наявного ПЗ. Використання спеціалізованого ПЗ для управління ризиками на підприємстві (@Rsk, Crystal Ball та ін.).	Виконання самостійної роботи	10
Тест до модуля 2				30
Разом за змістовим модулем 2				100
Всього за навчальну роботу	0,7 · (RЗМ 1 + RЗМ 2) R_{НР} = ----- 2			70
Підсумкова атестація (екзамен)				30
Всього за курс	R ДИС = R НР + R АТ			100

ПОЛІТИКА ОЦІНЮВАННЯ

<i>Політика щодо дедлайнів та перескладання:</i>	Роботи, які здаються із порушенням термінів без поважних причин, оцінюються на нижчу оцінку. Перескладання модулів відбувається із дозволу викладачів, які забезпечують курс за наявності поважних причин (наприклад, лікарняний).
<i>Політика щодо академічної доброчесності:</i>	Списування (копіювання тексту) під час виконання письмових контрольних робіт та екзаменів заборонені. Користування мобільними пристроями допускається лише з дозволу викладача під час онлайн-тестування та підготовки практичних завдань. Самостійні роботи у вигляді рефератів, доповідей, презентацій повинні мати коректні текстові посилання на використані інформаційні джерела.
<i>Політика щодо відвідування:</i>	Відвідування занять є обов'язковим. За об'єктивних причин (наприклад, хвороба, міжнародне стажування) навчання може відбуватись індивідуально в дистанційному режимі (у онлайн формі за погодженням із деканом факультету і лектором курсу).

ШКАЛА ОЦІНЮВАННЯ СТУДЕНТІВ

Рейтинг здобувача вищої освіти, бали	Оцінка національна за результати складання екзаменів
90-100	відмінно
74-89	добре
60-73	задовільно
0-59	незадовільно