Силабус освітнього компонента
Програма навчальної дисципліни

Ризик менеджмент

Шифр та назва спеціальності
073 – Менеджмент

Інститут
ННІ Економіки, менеджменту та міжнародного бізнесу

Освітня програма
Менеджмент організацій і адміністрування

Кафедра
Менеджменту (204)

Рівень освіти
Бакалавр

Тип дисципліни
Вільного вибору, профільної підготовки

Семестр
8

Мова викладання
Українська

Викладачі, розробники

Шиян Наталія Іванівна
Nataliia.Shyian@khpi.edu.ua
Доктор економічних наук, доцент кафедри Менеджменту НТУ "ХПІ"

Автор та співавтор понад 100 наукових та методичних публікацій.
Курси: Концепції стійкого розвитку, Ризик-менеджмент, Інноваційний менеджмент, Бізнес-етика та соціальна відповідальність.
https://web.kpi.kharkov.ua/mto/about/staff/shyian/

Загальна інформація

Анотація

Курс розвиває знання та навички, необхідні для зниження ризиків в процесі їх діяльності та розвитку шляхом ідентифікації, аналізу та оцінки ризиків; визначення чинників, які впливають на кризову ситуацію в організації; обрання методологічних підходів щодо зменшення ризиків, управління ними.

Мета та цілі дисципліни

Використання теоретичних знань та практичних навичок щодо наступних проблем: розуміння підходів до визначення сутності поняття "Ризик-менеджмент"; розгляд класифікації ризиків; індикаторів ризиків та методик щодо їх вимірювання; визначення сутності поняття "невизначеність", розгляд методик вимірювання ризиків в умовах невизначеності; управління фінансовими ризиками; підходи до зменшення ризиків в діяльності компанії

Формат занять

Лекції, практичні заняття, самостійна робота, консультації. Підсумковий контроль – диференційований залік.

Компетентності

ЗК03. Здатність до абстрактного мислення, аналізу, синтезу.
ЗК05. Знання та розуміння предметної області та розуміння професійної діяльності.
ЗК08. Навички використання інформаційних і комунікаційних технологій.
ЗК09. Здатність вчитися і оволодівати сучасними знаннями.
ЗК11. Здатність до адаптації та дії в новій ситуації.
СК02. Здатність аналізувати результати діяльності організації, зіставляти їх з факторами впливу зовнішнього та внутрішнього середовища.
СК12. Здатність аналізувати й структурувати проблеми організації, формувати обґрунтовані рішення.

Результати навчання

ПР03. Демонструвати знання теорій, методів і функцій менеджменту, сучасних концепцій лідерства.
ПР04. Демонструвати навички виявлення проблем та обґрунтування управлінських рішень.
ПР08. Застосовувати методи менеджменту для забезпечення ефективності діяльності організації.
ПР16. Демонструвати навички самостійної роботи, гнучкого мислення, відкритості до нових знань, бути критичним і самокритичним.

Обсяг дисципліни

Загальний обсяг дисципліни 150 год. (5 кредитів ECTS): лекції – 20 год., практичні заняття – 10 год., самостійна робота – 120 год.

Передумови вивчення дисципліни (пререквізити)

Для успішного проходження курсу необхідно мати знання та практичні навички з наступних дисциплін: "Основи менеджменту", "Теорія організації", "Фінанси".

Особливості дисципліни, методи та технології навчання

Інтерактивні лекції із презентаціями, дискусії, практичні кейси, індивідуальні завдання. Навчальні матеріали доступні студентам у OneNote.

Програма навчальної дисципліни

Теми лекційних занять

Тема 1. Поняття та визначення ризиків
Розуміння ризиків. Ризик-менеджмент. Стандарти Ризик-менеджменту.
Тема 2. Класифікація ризиків
Систематичні та несистематичні ризики. Типи ризиків.
Тема 3. Методи визначення ризику
Методи визначення ризику. Визначення імовірності настання ризику, його наслідків. Рівні ризику.
Тема 4. Показники ризику та підходи до його вимірювання
Стандартне відхилення, варіація, коефіцієнт Шарпа, Бета, Value at Risk.
Тема 5. Невизначеність в Ризик-менеджменті
Сутність невизначеності. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності. Методики визначення критеріїв невизначеності в Ризик-менеджменті.
Тема 6. Підприємницький ризик
Розуміння підприємницького ризику. Кількісні та якісні методи визначення підприємницького ризику.
Тема 7. Фінансовий Ризик-менеджмент
Сутність і типи фінансового ризику. Кредитний рейтинг компаній. Вимірювання фінансового ризику.
Тема 8. Зниження ризиків
Система зниження ризиків. Ідентифікація, оцінка, зменшення та передача ризиків в системі зниження ризиків.

Теми практичних занять

Тема 1. Сутність ризиків. Класифікація ризиків
Ризик-менеджмент стандарт. Класифікація ризиків.
Тема 2. Методи визначення ризиків. Показники ризику, підходи до його вимірювання
Побудова Матриці ризиків. Стандартне відхилення, Варіація. Коефіцієнт Шарпа, Бета.
Тема 3. Невизначеність в Ризик-менеджменті. Підприємницький ризик
Побудова Дерева рішень. Критерій Гурвіца. Максимізація грошового доходу.
Тема 4. Фінансовий Ризик-менеджмент
Розрахунок і вивчення показників стану діяльності компанії LVMN (Louis Vuitton Moët Hennessy).
Тема 5. Зниження ризиків
Система зниження ризиків. Ідентифікація, оцінка, зменшення та передача ризиків в системі зниження ризиків.
Тема 6. Підприємницький ризик
Розрахунковий приклад з максимізації грошового доходу компанії.
Тема 7. Фінансовий Ризик-менеджмент
Розрахунковий приклад з використання знань щодо визначення ризику в діяльності компанії.
Тема 8. Зниження ризиків
Система зниження ризиків. Ідентифікація, оцінка, зменшення та передача ризиків в системі зниження ризиків.

Теми лабораторних робіт

Лабораторні роботи в рамках дисципліни не передбачені.

Самостійна робота

Курс передбачає підготовку Есе, рефератів із ключових питань дисципліни. Студентам також рекомендуються додаткові матеріали (відео, статті) для самостійного аналізу та вивчення.

Література та навчальні матеріали

Основна література

1. Волинець І.Г. Обгрунтування господарських рішень та оцінювання ризиків. Луцьк. Вежа-друк, 2018 336 с.
2. Шиян Н.І. Обгрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків: курс лекцій. Харк. нац. аграр. ун-т ім. В.В. Докучаєва. Харків, 2014. -146 с.
3. Боровик М.В. Ризик-менеджмент: конспект лекцій. Харків. Нац. ун-т міськ. госп-ва ім. О.М. Бекетова. Харків: ХНУМГ ім. О.М. Бекетова, 2018. – 65 с.
4. Калініченко З.Д. Ризик-менеджмент: навч. посіб. Дніпро. ДДУВС, 2021. 224 с.

Додаткова література

1. Сосновська О.О. Ризик-менеджмент як інструмент забезпечення стійкого функціонування підприємства в умовах невизначеності. Європейський науковий журнал Економічних та фінансових інновацій. 2019. № 1(3). с. 70-79. URL: https://www.researchgate.net/publication/337130365_RIZIK-MENEDZMENT_AK_INSTRUMENT_ZABEZPECENNA_STIJKOGO_FUNKCIONUVANNA_PIDPRIEMSTVA_V_UMOVAH_NEVIZNACENOSTI.
2. Мостенська Т., Білан Ю. Ризик-менеджмент як чинник забезпечення економічної безпеки підприємств. Економіка та управління підприємствами. 2017. № 1. С. 193-203.
3. Шиян Н.І. Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків: Методичні рекомендації до практичних (семінарських) занять і самостійної роботи для здобувачів першого (бакалаврського) рівня вищої освіти. Харк. нац. аграр. ун-т ім. В.В. Докучаєва. Харків, 2020. – 42 с.
4. Чайкіна А. Особливості інтеграції ризик-менеджменту в систему управління підприємством. Економіка та суспільство. 2022. № 39. URL: https://economyandsociety.in.ua/index.php/journal/article/view/1337.

Система оцінювання

Критерії оцінювання успішності студента та розподіл балів

100% підсумкове оцінювання у вигляді фінального тесту (30%) та поточного оцінювання (70%).

30% Фінальний тест:
онлайн тест

70% поточне оцінювання:
10% індивідуальні завдання (письмове есе)
15% проміжний контроль (онлайн-тести)
40% оцінювання завдань на практичних заняттях
5% інші види активностей

Шкала оцінювання

Сума балів	Національна оцінка	ECTS
90–100	Відмінно	A
82–89	Добре	B
75–81	Добре	C
64–74	Задовільно	D
60–63	Задовільно	E
35–59	Незадовільно (потрібне додаткове вивчення)	FX
1–34	Незадовільно (потрібне повторне вивчення)	F

Норми академічної етики і політика курсу

Студент повинен дотримуватися «Кодексу етики академічних взаємовідносин та доброчесності НТУ «ХПІ»: виявляти дисциплінованість, вихованість, доброзичливість, чесність, відповідальність. Конфліктні ситуації повинні відкрито обговорюватися в навчальних групах з викладачем, а при неможливості вирішення конфлікту – доводитися до відома співробітників дирекції інституту. Нормативно-правове забезпечення впровадження принципів академічної доброчесності НТУ «ХПІ» розміщено на сайті: http://blogs.kpi.kharkov.ua/v2/nv/akademichna-dobrochesnist/

Погодження

Силабус погоджено	Дата погодження, підпис	Завідувач кафедри Олена ПРОХОРЕНКО
	Дата погодження, підпис	Гарант ОП Олена ЛІНЬКОВА