



Силабус освітнього компонента

Програма навчальної дисципліни



Ризик-менеджмент

Шифр та назва спеціальності

073 – Менеджмент

Інститут

Навчально-науковий інститут Економіки,
Менеджменту та Міжнародного бізнесу

Освітня програма

Менеджмент організацій і адміністрування

Кафедра

Менеджменту (204)

Рівень освіти

Магістр

Тип дисципліни

Спеціальна (фахова)), обов'язкова

Семестр

1

Мова викладання

Українська

Викладачі, розробники



Шиян Наталія

Nataliia.Shyian@khpi.edu.ua

Доктор економічних наук, доцент, професорка кафедри менеджменту НТУ "ХПІ"

Авторка і співавторка понад 100 наукових публікацій.
Курси з дисциплін: «Ризик менеджмент», «Інноваційний менеджмент», Бізнес-етика та соціальна відповідальність» та інші

Детальніше про викладача на сайті кафедри

<https://web.kpi.kharkov.ua/mto/about/staff/shyian/>

Загальна інформація

Анотація

Навчальна дисципліна "Ризик-менеджмент" спрямована на формування у студентів теоретичних знань та практичних навичок щодо:

розуміння ризиків в різних сферах діяльності;

методичних підходів до ідентифікації, оцінки, аналізу ризиків та планування діяльності

організації в стратегічному та тактичному розрізах;

визначення чинників впливу на кризову ситуацію;

обрання методичних підходів щодо підготовки та прийняття рішень в умовах невизначеності;

управління ризиками в різних умовах і сферах діяльності.

Мета та цілі дисципліни

Мета курсу – формування у студентів всебічного уявлення щодо проблеми ризиків в діяльності сучасних організацій, їх класифікації; практичного застосування конкретних методичних підходів до ідентифікації ризиків, їх вимірювання, аналізу; розробки, обґрунтування та забезпечення реалізації управлінських рішень в умовах ризику; розуміння особливостей ризиків в умовах

невизначеності та обґрунтування рішень за таких умов; формування комплексної системи знань з питань управління ризиками в різних сферах діяльності за різних станів їх розвитку.

Задачі курсу

Ознайомлення із сутністю та змістом ризик менеджменту; класифікацією ризиків в різних сферах діяльності.

Опанування студентами методичних підходів до ідентифікації, вимірювання, оцінки ризиків; побудови та використання матриці ризиків при прийнятті управлінських рішень.

Ознайомлення із підходами до прийняття рішень в ризик менеджменті в умовах невизначеності, планування непередбачуваних ситуацій та управління ними.

Формування системи знань із питань формування і розвитку стратегічного, операційного, проєктного, фінансового, екологічного ризик-менеджменту із визначенням етапів ризик-менеджменту, ідентифікації, оцінки, вимірювання ризику та розробки, реалізації заходів по управлінню ними в різних сферах діяльності.

Формування сукупності знань із звітності по управлінню ризиками.

Формат занять

Лекції, практичні заняття, семінари, самостійна робота, індивідуальна робота. Підсумковий контроль – екзамен.

Компетентності

ЗК6. Здатність генерувати нові ідеї (креативність).

СК11. Здатність самостійно опановувати і використовувати сучасні дослідницькі, комунікаційні і консалтингові технології у сфері управління організацією та адміністрування.

СК12. Здатність аналізувати результати діяльності організації, зіставляти їх з факторами впливу зовнішнього та внутрішнього середовища, приймати, обґрунтовувати та забезпечувати реалізацію управлінських рішень в умовах ризику.

Результати навчання

ПРН5. Планувати діяльність організації в стратегічному та тактичному розрізах.

ПРН14. Демонструвати навички проєктного управління, методів управління якістю та технології управлінського консультування для досягнення цілей організації.

ПРН15. Розуміти та використовувати технології виготовлення, прийняття та реалізації управлінських рішень щодо управління ризиками.

Обсяг дисципліни

Загальний обсяг дисципліни 150 год. (5 кредитів ECTS): лекції – 32 год., практичні заняття – 32 год., самостійна робота – 86 год.

Передумови вивчення дисципліни (пререквізити)

Для успішного вивчення дисципліни необхідно мати знання та практичні навички, які підтверджені вступним випробуванням з управління та адміністрування (Наказ МОН №157 від 11.02.2022).

Особливості дисципліни, методи та технології навчання

Лекції проводяться інтерактивно з використанням мультимедійних технологій при офлайн навчанні та програмного забезпечення корпоративної мережі Teams при онлайн навчанні. На практичних (семінарських заняттях) - дискусії, аналіз практичних ситуацій, розв'язання завдань з використанням табличного процесора MS Excel, програмного пакету для статистичного аналізу Statistica, виконання індивідуальних і групових завдань.

Навчальні, методичні, контрольні матеріали доступні студентам у One-Note в корпоративній мережі Teams, через чат відбувається миттєвий зворотній зв'язок

Програма навчальної дисципліни

Теми лекційних занять

Лекція 1. Тема 1. Сутність та зміст ризик-менеджменту

Ризик-менеджмент: підходи до визначення. Місце ризик-менеджменту в управлінні організацією. Принципи та цілі ризик менеджменту.

Лекція 2. Тема 1. Сутність та зміст ризик-менеджменту

Об'єкт та суб'єкт ризик менеджменту. Концепції управління ризиками.

Лекція 3. Тема 2. Класифікація ризиків

Підходи до класифікації ризиків. Типи ризиків, їх характеристика. Ризики відповідності. Ризики небезпеки. Ризики контролю. Ризики можливостей. Ризик-менеджмент стандарт.

Лекція 4. Тема 3. Методичні підходи до ідентифікації, вимірювання та оцінки ризиків

Суть ідентифікації ризиків в організації. Чек лист ідентифікації ризиків. Методичні підходи до ідентифікації ризиків: аналіз історичних даних; експертні оцінки; методи системного аналізу (SWOT-аналіз, PESTLE-аналіз); аналіз зацікавлених сторін; документальний аналіз.

Лекція 5. Тема 3. Методичні підходи до ідентифікації, вимірювання та оцінки ризиків

Суть методичних підходів до вимірювання і оцінки ризиків. Кількісні методи вимірювання та оцінки ризиків (статистичний аналіз, аналіз з використанням моделей). Якісні методи оцінки та вимірювання ризиків (експертні оцінки (метод Делфі, брейнстормінг, панельні дискусії), SWOT-аналіз). Матриця ризиків.

Лекція 6. Тема 4. Невизначеність і прийняття рішень в ризик-менеджменті

Класичні методи прийняття рішень (аналіз сценаріїв, рішення на основі теорії ймовірності; аналіз вигод і витрат). Моделі прийняття рішень (модель очікуваної корисності, Бассовський аналіз). Імовірність і величина ризику. Підходи до управління невизначеністю. Зменшення невизначеності (збір додаткової інформації, моделювання). Планування непередбачуваних ситуацій (розробка заходів на випадок надзвичайних ситуацій, гнучкість і адаптивність).

Лекція 7. Тема 5. Стратегічний ризик-менеджмент

Підходи до визначення стратегічних ризиків (аналіз внутрішніх і зовнішніх факторів, SWOT-аналіз). Стратегії управління стратегічними ризиками (унікнення ризиків, зменшення ризиків, передача ризиків, прийняття ризиків). Розробка планів реагування на ризики. Інтеграція управління ризиками в стратегічне планування. Моніторинг стратегічних ризиків.

Лекція 8. Тема 6. Операційний ризик-менеджмент

Сутність операційного ризику. Вимірювання операційного ризику. Розвиток операційного ризику. Розробка планів реагування на виникнення операційних ризиків.

Лекція 9. Тема 7 Проектний ризик-менеджмент

Сутність та розвиток проектного ризик-менеджменту. Невизначеність в розробці і реалізації проектів. Проектний ризик-аналіз та менеджмент. Основні етапи ризик-аналізу та менеджменту у проектах. Інструменти та техніки для управління ризиками. Переваги ефективного управління ризиками в проектах.

Лекція 10. Тема 8. Фінансовий ризик-менеджмент

Сутність фінансового ризик менеджменту. Основні етапи фінансового ризик-менеджменту. Типи фінансових ризиків (ринковий, кредитний, ліквідний, операційний, валютний, процентний).

Лекція 11. Тема 8. Фінансовий ризик-менеджмент

Оцінка фінансових ризиків (стандартне відхилення і варіація. Коефіцієнт Шарпа, Бета, Value at Risk). Інструменти та методи управління фінансовими ризиками (хеджування, диверсифікація, страхування).

Лекція 12. Тема 9. Екологічний ризик-менеджмент

Екологічні ризики: зміст, типи. Ідентифікація, оцінка, вимірювання екологічного ризику. Чек лист ідентифікації екологічного ризику. Екологічний ризик-менеджмент. Практичні аспекти зменшення екологічного ризику на рівні підприємства, галузі.

Лекція 13. Тема 10. Культура ризику

Визначення сутності культури ризику. Вимірювання культури ризику. Узгодження діяльності. Моделі зрілості ризику.

Лекція 14. Тема 11. Управління ризиками

Ризик менеджмент в організаційній структурі управління організацією. Методи управління ризиками (унікнення ризику, зниження ризику, передача ризику, прийняття ризику).

Лекція 15. Тема 11. Управління ризиками

Важливість управління ризиками (забезпечення стабільності, оптимізація ресурсів, захист репутації, підвищення конкурентоспроможності). Інструменти управління ризиками в різних сферах діяльності.

Лекція 16. Тема 12. Звітність по управлінню ризиками

Звітність по управлінню ризиками. Види звітності з управління ризиками компаній. Звітність з управління ризиками в державному секторі.

Теми практичних занять

Практичне заняття 1.

Тема 1. Ризики в діяльності організації

Доповіді студентів:

Наукові погляди засновників і представників класичної і неокласичної шкіл у розумінні змісту теорії ризику.

Етапи становлення і розвитку ризик-менеджменту.

Проведення дискусії. Знайти консенсус з питань практичного заняття.

Практичне заняття 2.

Тема 1. Місце ризик-менеджменту в управлінні організацією

SWOT-аналіз в ризик-менеджменті.

Використання SWOT-аналізу в діяльності сучасних організацій (на прикладі діючих компаній).

Обґрунтування місця ризик-менеджменту в управлінні організацією.

Проведення дискусії з питань практичного заняття.

Практичне заняття 3. Тема 2. Стандарти ризик-менеджменту

Практичні аспекти використання стандартів ризик-менеджменту в діяльності підприємств.

Стандарт (Стандарт з управління ризиками Федерації європейських ризик-менеджерів) FERMA.

Стандарт "Управління ризиками організацій. Інтегрована модель (COSO).

Стандарт ISO 31000-2018 "Менеджмент ризиків. Принципи та керівні вказівки.

ДСТУ ІЕС/ISO 31010:2013 "Керування ризиком. Методи загального оцінювання ризиків" та ін.

Командна робота. Висновки.

Практичне заняття 4. Тема 3. Практичні аспекти ідентифікації ризиків в організації

Доповіді студентів:

Джерела інформації для ідентифікації ризиків.

Чек-лист ідентифікації ризиків.

Інструменти ідентифікації ризиків. Брейнсторм.

Попередній аналіз небезпек РНА (Preliminary Hazard Analysis) в ідентифікації ризиків.

Дослідження HAZOP (Hazard and Operability Study) в ідентифікації ризиків.

Аналіз небезпеки та критичних контрольних точок HACCP (Hazard Analysis and Critical Control Points) в ідентифікації ризиків.

Аналіз видів та критичності відмов FMEA (Failure Mode Effect Analysis) в ідентифікації ризиків.

Побудова чек-листа ризиків організації.

Практичне заняття 5. Тема 3. Практичні аспекти вимірювання та оцінки ризиків

Панельні дискусії в оцінці ризиків.

Побудова матриці ризиків.

Тестування.

Практичне заняття 6. Тема 4. Підходи до обґрунтування управлінських рішень в умовах невизначеності

Розрахунок задач з використання критерію Лапласа-Бернуллі, критерію Вальда, критерію Севіджа при прийнятті рішень в умовах невизначеності.

Практичне заняття 7. Тема 5. Підходи до визначення стратегічних ризиків

PESTLE-аналіз в ризик-менеджменті.

Використання PESTLE -аналізу в діяльності сучасних організацій (на прикладі діючих компаній).

Проведення дискусії з питань практичного заняття.

Практичне заняття 8. Тема 6. Підходи до вимірювання операційного ризику

Кейс "Управління операційним ризиком в акціонерному товаристві "Банк "Український капітал".

Методика розрахунку мінімального операційного прибутку банку.

Методика Key Risk Indicators (KPI) в управлінні ризиками.

Командна робота. Висновки.

Практичне заняття 9. Тема 7. Інструменти та техніки для управління проєктним ризиками

Доповіді студентів:

Управління ризиками за фазами життєвого циклу проєкта.

Шкала оцінки впливу ризику при реалізації проєкту.

Принцип Парето в проєктному ризик-менеджменті.

Проведення дискусії. Знайти консенсус з питань практичного заняття.

Практичне заняття 10. Тема 8. Підходи до якісного оцінювання підприємницьких ризиків

Підходи до якісного оцінювання підприємницьких ризиків.

Методи експертних оцінок в ризик-менеджменті.

Аналіз ієрархії ризиків.

Мозковий штурм (Brainstorming) в ризик-менеджменті.

Розрахункові задачі з використанням підходів якісного оцінювання підприємницьких ризиків.

Практичне заняття 11. Тема 8. Підходи до кількісного оцінювання підприємницьких ризиків

Підходи до кількісного оцінювання підприємницьких ризиків.

Аналіз очікуваної грошової вартості.

Аналіз ризиків за допомогою статистичних методів.

Розрахункові задачі з використанням підходів кількісного оцінювання підприємницьких ризиків (Бета, Value at Risk, стандартне відхилення і варіація, коефіцієнт Шарпа).

Практичне заняття 12. Тема 9. Стандарти з охорони навколишнього природного середовища

Доповіді студентів:

Співвідношення понять небезпека, загроза, ризик.

Техноекосистеми та техногенні ризики.

Система екологічного управління (відповідно до ДСТУ ISO 14001:2015. Системи екологічного управління. Вимоги та настанови щодо застосування).

Підходи до оцінювання джерел небезпеки та ризику.

Модель оцінювання ризику з використанням розподілу Вейбулла-Гніденко.

Оцінювання техногенного і екологічного ризику на основі екологічно-економічних показників ефективності виробництва.

Оцінювання екологічного ризику на основі показників якості, індикаторів та індексів.

Проведення дискусії. Знайти консенсус з питань практичного заняття.

Практичне заняття 13. Тема 10. Культура ризику

Семинарське заняття:

Лідерство та підтримка з боку керівництва.

Відкриті комунікації.

Відповідальність і підзвітність.

Вбудованість у процеси прийняття рішень.

Підтримка прозорості.

Проведення дискусії.

Практичне заняття 14. Тема 11. Ризик-менеджмент в організаційній структурі управління підприємством

Навчальні кейси провідних компаній з питань місця ризик-менеджменту в організаційній структурі управління:

Greenbox ((Китай)

Siemens AG

Starbucks

Проведення дискусії.

Практичне заняття 15. Тема 11. Інформаційні системи управління ризиками

Навчальні кейси з питань використання спеціальних систем для автоматизації процесів управління ризиками:

Siemens AG

Starbucks

Проведення дискусії.

Практичне заняття 16. Тема 12. Інструменти і методи звітності з ризику

Практичні кейси з надання звітності з ризику в компаніях.

Контрольна робота

Теми лабораторних робіт

Лабораторні роботи в рамках дисципліни не передбачені

Самостійна робота

Курс передбачає самостійну підготовку студента до кожного практичного заняття через ознайомлення із додатковим матеріалом з навчальної дисципліни за темами та виконання індивідуальних завдань за проблемними питаннями курсу. Результат самостійної підготовки подається у вигляді презентацій.

Студентам також рекомендуються додаткові матеріали (відео, статті) для самостійного поглибленого вивчення.

Література та навчальні матеріали

1. Боровик М.В. Ризик-менеджмент : конспект лекцій для здобувачів другого (магістерського) рівня вищої освіти спеціальності 073 «Менеджмент». Харків : ХНУМГ ім. О. М. Бекетова, 2023. 63 с.
2. Демченко Г.В. Ризик менеджмент [Електронний ресурс] : конспект лекцій для студентів спеціальності 073 "Менеджмент". Харків : ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2021. 74 с.
3. Долінський Л. Фінансовий ризик-менеджмент : навч.-метод. посібник. НаУКМА, 2022. 132 с.
4. Скопенко Н.С., Федулова І.В., Мазник Л.В., Кириченко О.М., Удворгелі Л.І. Економічні ризики: методи вимірювання та управління : навч. посібник / за заг. ред. Скопенко Н.С. Київ : НУХТ, 2021. 344 с. URL: <https://dspace.nuft.edu.ua/server/api/core/bitstreams/ad3cf033-6858-4e2f-b001-85f9b3dc0d8f/content>
5. Horkin, P. Fundamentals of Risk Management: Understanding, evaluating and implementing effective risk management. 2017. 440 p. URL: <http://dspace.vnbrims.org:13000/jspui/bitstream/123456789/5077/1/Fundamentals%20of%20Risk%20Management.pdf>
6. Шиян Н.І. Окремі аспекти інвестиційної привабливості суб'єктів агробізнесу. Електронний журнал з економічних наук «Економіка та суспільство». [Електронний ресурс]. 2021. № 34. URL: <https://economyandsociety.in.ua/index.php/journal/article/view/967/925>
7. Шиян Н.І., Ковальова О.В. Окремі аспекти формування і розвитку системи контролінгу на підприємстві. Електронний журнал з економічних наук «Науковий вісник Одеського національного економічного університету» [Електронний ресурс]. 2022. № 3–4. С. 30–38. <https://doi.org/10.32680/2409-9260-2022-3-4-292-293-30-37>.
8. Шиян Н.І. Оцінювання показників ділової активності сільськогосподарських підприємств в умовах воєнного стану. Економіка та управління АПК. 2023. № 2. С. 86–96. С. DOI: <https://doi.org/10.33245/2310-9262-2023-18>
9. Шиян Н.І. Ризик-менеджмент: методичні вказівки до проведення семінарських та практичних занять з навчальної дисципліни для студентів галузі знань 07 «Управління та адміністрування» спеціальності 073 «Менеджмент» освітньо-кваліфікаційного рівня магістр усіх форм навчання / укл. Н.І. Шиян. Харків: НТУ «ХПІ», 2024. 55 с.
10. Шиян Н.І. Ризик-менеджмент: методичні вказівки до самостійної роботи з навчальної дисципліни для студентів галузі знань 07 «Управління та адміністрування» спеціальності 073 «Менеджмент» освітньо-кваліфікаційного рівня магістр усіх форм навчання / укл. Н.І. Шиян. – Харків: НТУ «ХПІ», 2024. 24 с.

Система оцінювання

Критерії оцінювання успішності здобувача та розподіл балів

100% підсумкової оцінки складаються з результатів поточного оцінювання на практичних (семінарських) заняттях (60%) та підсумкового оцінювання: складання екзамену (40%).

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

Здобувач вищої освіти 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



28.08.2024

Завідувач кафедри
Олена ПРОХОРЕНКО



28.08.2024

Гарант ОП
Оксана МАКОВОЗ