

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



РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТ
робоча програма навчальної дисципліни

Галузь знань **07 "Управління та адміністрування"**
Спеціальність **073 "Менеджмент"**
Освітній рівень **другий (магістерський)**
Освітня програма **"Бізнес-адміністрування"**

Статус дисципліни **обов'язкова**
Мова викладання, навчання та оцінювання **українська**

Завідувач кафедри
менеджменту та бізнесу

Тетяна ЛЕПЕЙКО

Харків
2022

ЗАТВЕРДЖЕНО

на засіданні кафедри менеджменту та бізнесу

Протокол № 1 від «29» серпня 2022 р.

Розробник(и):

Близнюк Тетяна Павлівна, д.е.н., доцент, професор кафедри менеджменту та бізнесу

Чмутова Ірина Миколаївна, д.е.н., професор, професор кафедри менеджменту та бізнесу

**Лист оновлення та перезатвердження
робочої програми навчальної дисципліни**

Навчальний рік	Дата засідання кафедри – розробника РПНД	Номер протоколу	Підпис завідувача кафедри

Анотація навчальної дисципліни

Аналіз ризику, характерного для діяльності конкретного підприємства, може допомогти знизити непередбачувані або випадково виникаючі витрати, пов'язані з вибором однієї з можливих альтернатив під час прийняття управлінського рішення особою будь-якого рівня управління. Урахування в діяльності суб'єктів господарювання факторів ризику дозволяє їм отримати певний ефект за мінімально можливих втрат під час здійснення фінансово-господарських операцій, реалізації інноваційно-інвестиційних проектів, проведенні інвестиційних розробок тощо. Сьогодення вимагає створення системи управління ризиками на підприємстві. «Ризик-менеджмент» надає методологічні, методичні знання, допомагає сформувати практичне вміння щодо аналізу, оцінювання і розроблення заходів, що допомагають ефективно управляти ризиками на підприємствах будь-якої форми власності. Вивчення дисципліни «Ризик-менеджмент» сприяє підвищенню рівня загальноекономічної підготовки здобувачів вищої освіти, формуванню у них навичок науково-аналітичного опрацювання проблем з пошуку ефективних методів управління ризиками.

Метою навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент» є формування у здобувачів вищої освіти системи професійних компетентностей щодо використання теоретичних основ, методичних рекомендацій і практичних навичок для управління ризиками.

Завданнями навчальної дисципліни є формування знань щодо системи теоретичних положень, прикладних вмінь та практичних навичок щодо управління економічними ризиками суб'єктів господарювання, процесу управління економічними ризиками, класифікації ризиків підприємства, обґрунтування управлінських рішень на основі кількісної та якісної оцінки економічного ризику, обґрунтування способів управління ризиками та формування стратегії й тактики ризик-менеджменту підприємства та вмінь щодо проведення процесу управління економічними ризиками на конкретному підприємстві та формування номенклатури економічних ризиків, що впливають на конкретне управлінське рішення.

Предметом навчальної дисципліни є теоретико-організаційні аспекти управління ризиками на підприємствах будь-якої форми власності та організаційно-правової форми господарювання з урахуванням видів діяльності, а також конкретні методи щодо управління та координації процесом управління ризиками.

Характеристика навчальної дисципліни

Курс	1М
Семестр	1
Кількість кредитів ECTS	5
Форма підсумкового контролю	Екзамен

Структурно-логічна схема вивчення навчальної дисципліни

Пререквізити	Постреквізити
Вища математика	Управління бізнес-фінансами
Фінанси	Технологія аналізу та планування бізнесу
Бухгалтерський облік	Технологія управління розвитком бізнесу
Теорія управління	

Компетентності та результати навчання за дисципліною

Компетентності	Результати навчання
ЗК1. Здатність проведення досліджень на відповідному рівні	РН1. Критично осмислювати, вибирати та використовувати необхідний науковий, методичний і аналітичний інструментарій для управління в непередбачуваних умовах
СК1. Здатність обирати та використовувати концепції, методи та інструментарій менеджменту, в тому числі у відповідності до визначених цілей та міжнародних стандартів	
СК9. Здатність аналізувати й структурувати проблеми організації, приймати ефективні управлінські рішення та забезпечувати їх реалізацію	
СК11. Здатність обґрунтовувати управлінські рішення на основі кількісної та якісної оцінки ризиків	
ЗК3. Навички використання інформаційних та комунікаційних технологій	РН2. Ідентифікувати проблеми в організації та обґрунтовувати методи їх вирішення
СК2. Здатність встановлювати цінності, бачення, місію, цілі та критерії, за якими організація визначає подальші напрями розвитку, розробляти і реалізовувати відповідні стратегії та плани	
СК2. Здатність встановлювати цінності, бачення, місію, цілі та критерії, за якими організація визначає подальші напрями розвитку, розробляти і реалізовувати відповідні стратегії та плани	РН5. Планувати діяльність організації в стратегічному та тактичному розрізах
ЗК6. Здатність генерувати нові ідеї (креативність)	РН6. Мати навички прийняття, обґрунтування та забезпечення реалізації управлінських рішень в непередбачуваних умовах, враховуючи вимоги чинного
СК1. Здатність обирати та використовувати концепції, методи та інструментарій менеджменту, в тому числі у відповідності до визначених цілей та міжнародних стандартів	
СК9. Здатність аналізувати й структурувати проблеми організації, приймати ефективні управлінські рішення та забезпечувати їх реалізацію	
СК11. Здатність обґрунтовувати управлінські рішення на основі кількісної та якісної оцінки ризиків законодавства, етичні міркування та соціальну відповідальність	
СК11. Здатність обґрунтовувати управлінські рішення на основі кількісної та якісної оцінки ризиків	РН14. Застосовувати та створювати комплексні управлінські технології, методи й інструменти для ефективного та результативного управління бізнесом в умовах ризику
СК12. Здатність розробляти та застосовувати методи і технології комплексного управління організацією	

Програма навчальної дисципліни

Змістовий модуль 1. Теоретичні основи ризик-менеджменту

Тема 1. Управління ризиками діяльності підприємства

Основні поняття і визначення. Значення та необхідність управління економічними ризиками на підприємстві.

Класифікація економічних ризиків. Задачі управління економічними ризиками на підприємстві. Сутність, характеристика процесу управління економічними ризиками. Ризик-менеджмент. Система економічних ризиків.

Тема 2. Оцінка економічних ризиків

Методи оцінки економічного ризику, їх характеристика і зміст. Розподіл методів економічних ризиків.

Кількісні методи оцінки економічних ризиків. Переваги та недоліки основних кількісних методів оцінки економічних ризиків.

Якісні методи оцінки ризиків, сутність та характеристика. Особливості використання кількісних та якісних методів оцінки економічних ризиків.

Тема 3. Методи управління економічними ризиками

Точки зору щодо шляхів впливу на рівень економічного ризику. Аналіз шляхів впливу на рівень економічного ризику. Характеристика способів та прийомів щодо управління економічними ризиками.

Емпіричний арсенал управління економічними ризиками та їх характеристика. Аналіз системи управління економічними ризиками на підприємстві. Вплив зовнішніх та внутрішніх факторів на економічні ризики підприємства

Тема 4. Система управління економічними ризиками

Системний підхід щодо управління економічними ризиками на підприємстві. Етапи управління економічними ризиками та їх характеристика. Інформаційна база процесу управління ризиками.

Централізована система управління економічними ризиками. Складові системи управління економічними ризиками на підприємстві. Управління ризиком як специфічна сфера менеджменту.

Основні підходи до управління ризиком як системи. Ризик-менеджмент як система. Функції об'єкта й суб'єкта управління ризиками. Стратегія і тактика ризик-менеджменту. Способи управління ризиками. Система управління економічними ризиками на підприємстві як складова підприємства як системи.

Перелік практичних (семінарських) / лабораторних занять, а також питань та завдань до самостійної роботи наведено у таблиці "Рейтинг-план навчальної дисципліни".

Методи навчання та викладання

У процесі викладання навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент» для реалізації визначених компетентностей освітньої програми та активізації освітнього процесу на лекційних, практичних та лабораторних заняттях з «Ризик-менеджменту» передбачено застосування таких методів навчання як: проблемні лекції (тема 4), міні-лекції (тема 2), презентації (теми 1-4), міні-тренінги (тема 3), кейс-метод (теми 1 – 4), індивідуальна дослідницька робота в процесі виконання компетентнісно-орієнтованих завдань (теми 1 – 4).

Під час проведення лекційних, практичних та лабораторних занять використовуються: пояснювально-ілюстративний, репродуктивний, частково-пошуковий і дослідницький методи викладання та проблемне викладання.

Порядок оцінювання результатів навчання

ХНЕУ ім. С. Кузнеця використовує накопичувальну (100-бальну) систему оцінювання. Оцінка базується на таких видах контролю:

1) поточний контроль, який здійснюється протягом семестру під час практичних та лабораторних занять за кількістю набраних балів.

Формами поточного оцінювання та методами демонстрації результатів навчання є

наступні форми самостійної роботи:

звіти з компетентнісно-орієнтованих завдань. Протягом семестру є два компетентнісно-орієнтованих завдання. Максимальна оцінка – 5 балів за кожне повністю виконане завдання, мінімальна оцінка – 2 бали за розрахунок 50% показників без наведеного управлінського рішення. Загальна кількість балів 10 балів;

звіти з лабораторних завдань. протягом семестру є п'ять лабораторних робіт. Максимальна оцінка – 6 балів за кожну лабораторну роботу, мінімальна оцінка – 4 бали за розрахунок 50% показників. Загальна кількість балів 30 балів;

есе – протягом семестру необхідно підготувати 1 есе. Максимальна оцінка – 6 балів при повному розкритті теми есе, мінімальна оцінка – 3 бали за наявності розмірковувань щодо теми есе, але відсутності вступу та висновків;

поточна контрольна робота 1, включає теми 1–2. Максимальна оцінка – 7 балів при повному виконанні завдань, мінімальна оцінка – 4 бали за розрахунок 50% показників без наведення пояснень та висновків;

поточна контрольна робота 2, включає теми 3–4. Максимальна оцінка – 7 балів при повному виконанні завдань, мінімальна оцінка – 4 бали за розрахунок 50% показників без наведення пояснень та висновків.

Максимальна оцінка за поточним контролем складає – 60 балів, мінімальна оцінка – 35 балів, що дозволяє отримати залік.

2) підсумковий контроль проводиться у формі іспиту згідно з розкладом навчального процесу. Підсумковий контроль включає всі теми навчальної дисципліни (теми 1 – 4). Структура екзаменаційного білету: 1) два стереотипні практичні завдання/проблемні ситуації (максимальна оцінка – 4 бали); 2) два діагностичні практичні завдання/проблемні ситуації (максимальна оцінка – 7 балів); 3) одне евристичне практичне завдання/проблемна ситуація (максимальний бал – 18 балів). Максимальний бал на іспиті – 40 балів, мінімальний бал – 25 балів.

Порядок проведення поточного оцінювання знань студентів.

Оцінювання знань студентів під час лабораторних, практичних занять та виконання індивідуальних завдань здійснюється за такими критеріями:

- розуміння, ступінь засвоєння теорії та методології проблем, що розглядаються; ступінь засвоєння фактичного матеріалу дисципліни; ознайомлення з рекомендованою літературою, а також сучасною літературою з питань, що розглядаються; вміння поєднувати теорію з практикою при розгляді виробничих ситуацій у процесі виконання індивідуальних завдань і завдань, що виносяться на розгляд в аудиторії;

- узагальнювати інформацію та робити висновки; уміння пояснювати альтернативні погляди та наявність власної точки зору, позиції з певного проблемного питання; застосування аналітичних підходів; якість і ясність аргументації; логічність, структурування та обґрунтованість висновків з конкретної проблеми; самостійність роботи; грамотність викладу матеріалу; використання методів порівняння, узагальнень понять і явищ; оформлення роботи.

Загальними критеріями оцінювання самостійної роботи студентів є: глибина та міцність знань, рівень мислення, уміння систематизувати знання з окремих тем, уміння робити обґрунтовані висновки, володіння категоріальним апаратом, уміннями та прийомами виконання практичних завдань, уміння знаходити необхідну інформацію, здійснювати її систематизацію та обробку, самореалізація на практичних і семінарських заняттях.

Залік виставляється як загальна сума балів, набраних за результатами поточного та підсумкового контролю (максимальна оцінка – 100 балів, мінімальна оцінка – 60 балів).

Форми оцінювання та розподіл балів наведено у таблиці "Рейтинг-план навчальної дисципліни".

Рейтинг-план навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент»

Тема	Форми та види навчання	Форми оцінювання	Мах бал
1	2	3	4
Змістовий модуль 1. Теоретичні основи ризик-менеджменту			
Тема 1	<i>Аудиторна робота</i>		
	Лекції 1 і 2 за питаннями: 1) економічна сутність ризику та його класифікація 2) можливі причини виникнення ризиків 3) ризик-менеджмент як галузь наукового управління 4) мета та задачі ризик-менеджменту	Активна робота	
	Лабораторна робота 1. Визначення міри ризику	Виконання лабораторної роботи	6
	Практичне заняття 1: Управління ризиками діяльності підприємства	Виконання практичної роботи	
	<i>Самостійна робота</i>		
Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до лабораторного заняття, підготовка до практичного заняття			
Тема 2	<i>Аудиторна робота</i>		
	Лекції 3 і 4 за питаннями: 1) методологія аналізу та оцінки ризику 2) якісні методи оцінки ризику 3) кількісні методи оцінки ризику 4) функція корисності	Активна робота	
	Лабораторна робота 2. Побудова дерева рішень з використанням Excel	Виконання лабораторної роботи	6
	Практичне заняття 2: Методи оцінки економічних ризиків	Виконання практичної роботи Поточна контрольна робота 1	7
	<i>Самостійна робота</i>		
Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до лабораторного заняття, підготовка до практичного заняття, підготовка до контрольної роботи 1			
Тема 3	<i>Аудиторна робота</i>		
	Лекції 5 і 6 за питаннями: 1) рівень економічного ризику 2) способи та прийоми управління економічними ризиками 3) система управління економічними ризиками на підприємстві	Активна робота	
	Лабораторна робота 3. Побудова дерева рішень з використанням Excel	Виконання лабораторної роботи	6

	Практичне заняття 3: Методи оцінки економічних ризиків	Виконання практичної роботи Захист практичних робіт	5
Самостійна робота			
	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до лабораторного заняття, підготовка до практичного заняття		
Аудиторна робота			
Тема 4	Лекції 7 і 8 і за питаннями: 1) системний підхід щодо управління економічними ризиками на підприємстві 2) стратегія і тактика ризик-менеджменту 3) методи управління ризиками 4) система управління економічними ризиками на підприємстві як складова підприємства як системи	Активна робота	
	Лабораторна робота 4: Підприємницькі ризики та регулювання їхнього ступеня	Виконання лабораторної роботи	6
	Лабораторна робота 5. Аналіз чутливості інноваційного проекту	Виконання лабораторної роботи	6
	Практичне заняття 4: Методи оцінки економічних ризиків	Виконання практичної роботи Захист практичних робіт	5
	Практичне заняття 5: Аналіз чутливості інноваційного проекту	есе	6
		Поточна контрольна робота 2	7
	Самостійна робота		
	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до лабораторного заняття, підготовка до контрольної роботи 2, написання есе		
Іспит			40

Рекомендована література

Основна

1. 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. [Електронний ресурс] – Режим доступу: <https://core.ac.uk/download/pdf/154806591.pdf>.
2. Калініченко З.Д. Ризик-менеджмент / З.Д. Калініченко. – Дніпро: ДДУВС, 2021. – 224 с. [Електронний ресурс] – Режим доступу: <https://er.dduvs.in.ua/bitstream>.

3. Мороз В.М. Ризик-менеджмент / В.М. Мороз, С.А. Мороз. – Харків: НТУ «ХП», 2018. – 140 с. [Електронний ресурс] – Режим доступу: http://repository.kpi.kharkov.ua/bitstream/KhPIPress/39143/1/Book_2018_Moroz_Ryzuk_menedzhment.pdf.

Додаткова

4. Стешенко О. Д. Ризикологія: Навч. посібник. / О. Д. Стешенко – Харків: УкрДУЗТ, 2019. – 180 с. [Електронний ресурс] – Режим доступу: <http://lib.kart.edu.ua/bitstream>.

5. Черненко Н.М. Ризик-менеджмент у закладах освіти: навчальний посібник. / Н.М. Черненко. – Вид., О.: Університет Ушинського, 2020. – 116 с. [Електронний ресурс] – Режим доступу: <http://dspace.pdpu.edu.ua/bitstream/123456789/9759/1/Chernenko.%202020.pdf>.

Інформаційні ресурси в Інтернеті

6. Ризик-менеджмент: сторінка курсу на PNS (платформа Moodle) – Режим доступу: <https://pns.hneu.edu.ua/course/view.php?id=687>.

7. ISO / IEC 31010:2009 Risk management – Risk assessment techniques [Електронний ресурс] – Режим доступу: http://www.iso.org/iso/ru/catalogue_detail?csnumber=51073.

8. 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>.