

Міністерство освіти і науки України

Харківський національний університет імені В.Н. Каразіна

Кафедра економіки та менеджменту

“ЗАТВЕРДЖУЮ”

Проректор з науково-педагогічної роботи

канд. хімічних наук, доц.

Пантелеймонов А. В.

“ _____ ” _____ 2018р.

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Управління ризиками в менеджменті

(назва навчальної дисципліни)

рівень вищої освіти Перший (бакалаврський) рівень вищої освіти

галузь знань 07 Управління та адміністрування

(шифр і назва)

напрямок підготовки 6.030601 Менеджмент

(шифр і назва)

освітні програми _____

(шифр і назва)

спеціалізація Менеджмент організацій і адміністрування

(шифр і назва)

вид дисципліни обов'язкова

(обов'язкова / за вибором)

факультет Економічний

2018 / 2019 навчальний рік

Програму рекомендовано до затвердження вченою радою економічного факультету “23” червня 2018 року, протокол № 8

РОЗРОБНИКИ ПРОГРАМИ: **Пуртов В.Ф.**, кандидат економічних наук, доцент кафедри економіки та менеджменту, **Прокопенко В.Ю.**, доктор економічних наук, професор кафедри економіки та менеджменту

Програму схвалено на засіданні кафедри економіки та менеджменту

Протокол від “20” червня 2018 року № 13

Завідувач кафедри економіки та менеджменту

_____ Дорошенко Г.О.
(підпис) (прізвище та ініціали)

Програму погоджено методичною комісією економічного факультету _____
назва факультету, для здобувачів вищої освіти якого викладається навчальна дисципліна

Протокол від “21” червня 2018 року № 9

Голова методичної комісії економічного факультету

_____ Євтушенко В.А.
(підпис) (прізвище та ініціали)

ВСТУП

Програма навчальної дисципліни «Управління ризиками в менеджменті» складена відповідно до спеціалізації підготовки

Першого рівня вищої освіти освітньо-кваліфікаційного рівня «бакалавр»

Напряму підготовки 6.030601 Менеджмент

спеціалізації Менеджмент організацій і адміністрування

1. Опис навчальної дисципліни

1.1. Метою вивчення дисципліни є формування системних знань з концептуальних основ управління ризиками сучасних підприємств на основі інтегрування процесу ризик-менеджменту в загальну систему управління підприємством, стратегію і планування, менеджмент, процеси звітності, політику, цінності та культуру.

1.2. Основними завданнями вивчення дисципліни є :

- системно досліджувати результати діяльності організацій і підприємств та усвідомити роль ризик-менеджменту у підвищенні ймовірності досягнення цілей та для підтримки проактивного менеджменту;
- опанувати сутність ризик-менеджменту та його методичні основи;
- вивчити принципи, методи, процедури та інструменти, які необхідні для успішної реалізації цієї технології в практиці управління організаціями і підприємствами;
- навчитися використовувати методи оцінки ризику залежно від галузі та типу соціально-економічної системи;
- досліджувати основні закони, закономірності, принципи і концепції вироблення, прийняття і реалізації управлінських рішень з

удосконалення функціонування організацій з використанням технологій ризик-менеджменту.

1.3. Кількість кредитів 3 ECTS – для денної форми навчання, та 3 ECTS для заочної форми навчання

1.4. Загальна кількість годин 90 год. для денної форми навчання, та 90 год. для заочної форми навчання

| 1.5. Характеристика навчальної дисципліни | |
|---|-------------------------------------|
| Обов'язкова | |
| Денна форма навчання | Заочна (дистанційна) форма навчання |
| Рік підготовки | |
| 4-ий | 4-ий |
| Семестр | |
| 8-ий | 8-ий |
| Лекції | |
| 24 год. | 6 год. |
| Практичні, семінарські заняття | |
| 12 год. | 2 год. |
| Самостійна робота | |
| 49 год. | 77 год. |
| Індивідуальні завдання | |
| 5 год. год. | 5 год. |

1.6. Заплановані результати навчання.

В процесі вивчення даного модуля в студентів формуються елементи професійних компетенцій:

- знати сутність ризиків, їх види та процес ризик-менеджменту;
- знати концептуальні засади, цілі і завдання використання методів і технології управління ризиками;
- знати фактори, причини та джерела виникнення ризиків;
- знати принципи ризик-менеджменту;

- знати методи оцінки ризику, визначати наслідки та ймовірності їх настання у майбутньому, встановлення факторів, що визначають ризик та елементи процесу ризик-менеджменту;
- вміти ідентифікувати ризики підприємства, визначати їх причини та джерела визначення;
- вміти оцінювати ризики діяльності підприємства, використовуючи різні методи;
- вміти ефективно управляти ризиками, вибирати методи для оптимізації ризиків;
- вміти формувати програму управління ризиками підприємств, складати стратегічну карту ризиків.

2. Тематичний план навчальної дисципліни

Тема 1. Сутність ризику як економічної категорії. Функції ризику.

Тема 2. Класифікація ризиків підприємства

Традиційний підхід щодо класифікації ризиків господарської д-ті підприємства. Класифікація ризиків в залежності від етапів життєвого циклу підприємства. Загальні ризики підприємства та їх характеристика.

Тема 3. Управління ризиками на підприємстві.

Поняття ризик-менеджменту, його мета та завдання. Принципи ризик-менеджменту. Підходи до процесу управління ризиками. Характеристика етапів процесу ризик-менеджменту.

Тема 4. Система антикризових заходів на підприємстві.

Аналіз ризиків господарської діяльності підприємства. Класифікація втрат і їх оцінювання. Основні шляхи і методи оптимізації ризику на підприємстві.

Тема 5. Оцінювання ризиків діяльності підприємства

Загальні методи оцінки ризику. Спеціальні методи оцінки ризику.

Тема 6. Програма управління ризиками на підприємстві

Установлення контексту ризику. Методи виявлення ризиків. Оцінка ризику.

Складання карти ризиків. Рішення про управління ризиками. Методи управління ризиками.

Тема 7. Управління інвестиційними ризиками.

Принципи оцінки ефективності інвестиційних проектів. Види ризиків при оцінці проектів. Методи аналізу ризиків проектів.

Тема 8. Управління фінансовими ризиками

Поняття фінансового ризику. Принципи управління фінансовими ризиками.

Схема управління фінансовим ризиками. Методи впливу на фінансові ризики.

Тема 9. Ризик-менеджмент у сфері маркетингу.

Ризики в маркетингу. Управління ризиками під час проведення маркетингових досліджень. Аналіз ризиків споживача.

Тема 10. Операційний ризик-менеджмент.

Особливості виявлення операційних ризиків. Оцінка операційних ризиків.

Особливості аналізу операційних ризиків у фінансових інститутах

3. Структура навчальної дисципліни

| Назви розділів і тем | Кількість годин | | | | | | | | | | | |
|--|-----------------|--------------|-----|------|------|------|--------------|--------------|----|------|------|------|
| | денна форма | | | | | | заочна форма | | | | | |
| | усього | у тому числі | | | | | усього | у тому числі | | | | |
| | | л | п | лаб. | інд. | с.р. | | л | п | лаб. | інд. | с.р. |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 |
| Тема 1. Сутність ризику як економічної категорії. Функції ризику | 9 | 2 | 1 | | | 6 | 6,5 | 0,5 | | | | 6 |
| Тема 2. Класифікація ризиків підприємства | 8 | 2 | 2 | | | 4 | 6,5 | 0,5 | | | | 6 |
| Тема 3. Управління ризиками на підприємстві. | 9 | 2 | 1 | | | 6 | 9 | 1 | | | | 8 |
| Тема 4. Система антикризових заходів на підприємстві | 14 | 4 | 2 | | | 8 | 13 | 1 | | | | 12 |
| Тема 5. Оцінювання ризиків діяльності підприємства | 12 | 2 | 2 | | | 8 | 19 | 1 | 2 | | | 16 |
| Тема 6. Програма управління ризиками на підприємстві | 5 | 2 | 1 | | | 2 | 9 | 1 | | | | 8 |
| Тема 7. Управління інвестиційними ризиками. | 6 | 2 | 1 | | | 3 | 5 | | | | | 5 |
| Тема 8. Управління фінансовими ризиками | 9 | 4 | 1 | | | 4 | 6 | 1 | | | | 5 |
| Тема 9. Ризик-менеджмент у сфері маркетингу | 6,5 | 2 | 0,5 | | | 4 | 5 | | | | | 5 |
| Тема 10. Операційний ризик-менеджмент | 6,5 | 2 | 0,5 | | | 4 | 3 | | | | | 3 |
| Індивідуальне завдання (контрольна робота) | 5 | | | | 5 | | 8 | | | | 5 | 3 |
| Разом | 90 | 24 | 12 | | 5 | 49 | 90 | 6 | 2 | | 5 | 77 |
| Усього годин | 90 | 24 | 12 | | 5 | 49 | 90 | 6 | 2 | | 5 | 77 |

4. Теми практичних занять

| № з/п | Назва теми | Кількість Годин | |
|-------|---|-----------------|--------|
| | | Денна | Заочна |
| 1. | Сутність ризику як економічної категорії. Функції ризику. | 1 | 0,5 |
| 2. | Класифікація ризиків підприємства | 1 | 0,5 |
| 3. | Управління ризиками на підприємстві | 2 | |
| 4. | Розроблення системи антикризових заходів | 1 | |
| 5. | Оцінювання ризику діяльності підприємств | 2 | 0,5 |
| 6. | Програма управління ризиками на підприємстві | 1 | |
| 7. | Управління інвестиційними ризиками | 1 | |
| 8. | Управління фінансовими ризиками | 1 | |
| 9. | Ризик-менеджмент у сфері маркетингу | 0,5 | |
| 10. | Операційний ризик-менеджмент | 1 | |
| 11. | Контрольна робота | 0,5 | 0,5 |
| | Усього | 12 | 2 |

5. Завдання для самостійної роботи

| № з/п | Види, зміст самостійної роботи | Кількість Годин | |
|-------|---|-----------------|--------|
| | | Денна | Заочна |
| 1. | Опрацювання теоретичного матеріалу лекції | 20 | 40 |
| 2. | Робота з рекомендованою літературою | 10 | 20 |
| 3. | Підготовка до практичних занять | 14 | 14 |
| 4. | Підготовка до написання контрольних робіт | 5 | 5 |
| | Разом | 49 | 79 |

Перелік питань для самостійного вивчення

1. Історія розвитку ризик-менеджменту
2. Підходи до визначення поняття ризик.
3. Обґрунтуйте об'єктивно-суб'єктивну природу ризику.
4. Назвіть та охарактеризуйте основні елементи ризику.
5. Поняття ризик-менеджменту, його основна мета
6. Назвіть та поясніть основні причини ризику
7. Назвіть та поясніть основні функції ризику

8. Назвіть та поясніть джерела ризику.
9. Наведіть та охарактеризуйте тривимірну модель ризику
10. Особливості сучасного ризику.
11. Характеристика видів ризику. Правовий аспект ризику
12. Взаємозв'язок принципів ризик-менеджменту з принципами менеджменту.
13. Математичні методи оцінки економічних ризиків
14. Оцінка ризику на основі аналізу фінансового стану підприємства
15. Переваги та недоліки різних методів оцінки ризиків.
16. Кількісні оцінки економічного ризику в умовах невизначеності. Матричні ігри.
17. Управління інвестиційними проектами в умовах ризику
18. Аналіз ефективності методів управління ризиками
19. Роль страхування в управлінні ризиками. Страховий бізнес в ринковій економіці.
20. Стратегія ризик менеджменту
21. Шляхи і джерела фінансування ризиків
22. Класифікація рішень управління ризиками. Типові алгоритми ризик-рішень.

6. Індивідуальні завдання

Навчальним планом передбачено одну контрольну роботу для денної та заочної форми навчання.

7. Методи контролю

1. Перевірка домашнього завдання.
2. Опитування за темою лекції.
3. Написання термінологічних диктантів.
4. Написання підсумкової контрольної роботи.

8. Схема нарахування балів

Оцінкою підсумкового семестрового контролю є сума балів, набраних здобувачем вищої освіти протягом семестру при виконанні контрольних заходів, передбачених програмою навчальної дисциплін та балів, набраних ним при складанні семестрового екзамену. Максимальна сума балів, яку може набрати здобувач вищої освіти при підсумковому семестровому поточному та підсумковому контролі, складає 100.

Нарахування балів для студентів денної форми навчання:

| Поточний контроль, самостійна робота, індивідуальні завдання | | | | Сума |
|--|------------------------|--|-------|------|
| T1-T10 | Індивідуальне завдання | Контрольна робота, передбачена навчальним планом | Разом | |
| По 6 балів | | 40 | 100 | 100 |

Нарахування балів для студентів заочної форми навчання:

| Поточний контроль, самостійна робота, індивідуальні завдання | | | | Сума |
|--|------------------------|--|-------|------|
| T1-T10 | Індивідуальне завдання | Контрольна робота, передбачена навчальним планом | Разом | |
| По 6 балів | | 40 | 100 | 100 |

Шкала оцінювання

| Сума балів за всі види навчальної діяльності протягом семестру | Оцінка |
|--|----------------------------------|
| | для дворівневої шкали оцінювання |
| 90 – 100 | зараховано |
| 70-89 | |
| 50-69 | |
| 1-49 | не зараховано |

9. Рекомендована література

Основна література

1. Вітлінський В. В. Ризикологія в економіці та підприємстві : Монографія / В. В. Вітлінський, Г. І. Великоіваненко. — К. : КНЕУ, 2004. — 480 с.
2. Внукова Н. М. Економічна оцінка ризику діяльності підприємств : проблеми теорії та практики / Н. М. Внукова, В. А. Смоляк. — Харків : ВД "ІНЖЕК", 2006. — 181 с.
3. Гранатуров В. М. Аналіз підприємницьких ризиків: проблеми визначення, класифікації та кількісної оцінки / Гранатуров В. М., Литовченко І. В., Харічков С. К. — Одеса, 2003. — 164 с.
4. Гранатуров В. М. Экономический риск: сущность, методы измерения, пути снижения / В. М. Гранатуров. — М. : Дело и Сервис, 1999. — 112 с.
5. Івченко І. Ю. Економічні ризики : Навчальний посібник / Івченко І. Ю. — К. : Центр навчальної літератури, 2004. — 304 с.
6. Лещинський О. Л. Економічний ризик та методи його вимірювання : Навчальний посібник для студентів вищих навчальних закладів / О. Л. Лещинський, О. В. Школьний. — К. : Дельта, 2005. — 112 с.
7. Лук'янова В. В. Економічний ризик : навчальний посібник / В. В. Лук'янова, Т. В. Головач. — К. : Академвидав, 2007. — 462 с.
8. Машина Н. І. Економічний ризик і методи його вимірювання : Навчальний посібник / Машина Н. І. — К. : Центр навчальної літератури, 2003. — 188 с.
9. Старостіна А. О. Ризик-менеджмент : теорія та практика : Навчальний посібник / А. О. Старостіна, В. А. Кравченко. — К. : ІВЦ „Видавництво „Політехніка", 2004. — 200 с.
10. Ястремський О. І. Моделювання економічного ризику / Ястремський О. І. — К. : Либідь, 1992. — 176 с.

Допоміжна література

Посилання на інформаційні ресурси в Інтернеті, відео-лекції, інше методичне забезпечення

1. Про наукову і науково-технічну діяльність [Електронний ресурс]. — Електрон. дан. — К.: Верховна Рада України. — Режим доступу: [http:// zakon1.rada.gov.ua/cgi-bin/laws/main.cgi?nreg=1977-12](http://zakon1.rada.gov.ua/cgi-bin/laws/main.cgi?nreg=1977-12).
2. Харківська державна наукова бібліотека ім. В. Г. Короленка, пров. Короленка, 18. E-mail: ls@korolenko.kharkov.com, <http://korolenko.kharkov.com>
3. Харківська обласна універсальна наукова бібліотека, вул. Кооперативна, 13/2. E-mail: director@library.kharkov.ua , <http://www.library.kharkov.ua>
4. Міністерство фінансів України – <http://www.minfin.gov.ua>
5. Національний банк України – <http://bank.gov.ua/NBU/index.htm>
6. Харківська обласна рада – <http://www.oblrada.kharkov.ua>
7. Державна податкова адміністрація України – <http://www.sta.gov.ua>