

Міністерство освіти і науки України
Харківський національний університет імені В.Н. Каразіна
Кафедра економічної теорії та економічних методів управління

“ЗАТВЕРДЖУЮ”
Проректор з науково-педагогічної роботи
Пантелеймонов А.В.

“_____” червня 2018 р.

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ

(назва навчальної дисципліни)

рівень вищої освіти бакалавр

галузь знань 05 «Соціальні та поведінкові науки»

спеціальність 051 «Економіка»

освітня програма «Економіка та економічна політика»

спеціалізація _____

вид дисципліни вибіркова

факультет економічний

2018 / 2019 навчальний рік

Програму рекомендовано до затвердження Вченою радою економічного факультету протокол № 8 від “ 22 ” червня 2018 року,

РОЗРОБНИКИ ПРОГРАМИ: Коломієць Г.М. д.е.н., проф.
Професор кафедри економічної теорії та економічних методів управління

Програму схвалено на засіданні кафедри економічної теорії та економічних методів управління
Протокол № 10 від “ 01 ” червня 2018 року

Завідувач кафедри
економічної теорії та економічних методів управління _____
Гриценко А.А.

Програму погоджено методичною комісією економічного факультету Харківського національного університету імені В.Н.Каразіна

Протокол № 9 від “ 21 ” червня 2018 року

Голова методичної комісії _____ Євтушенко В.А.

ВСТУП

Програма навчальної дисципліни “УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ” складена відповідно до освітньо-професійної програми підготовки

першого рівня вищої освіти, освітньо –кваліфікаційного рівня бакалавр
(назва рівня вищої освіти, освітньо-кваліфікаційного рівня)

Спеціальність: 051 Економіка,

1. Опис навчальної дисципліни

1.1. Метою викладання навчальної дисципліни є сформувати розуміння ризику господарської діяльності і здатність приймати адекватні рішення в ризиковому середовищі

1.2. Основні завдання вивчення дисципліни

- 1) засвоєння новітніх знань і узагальненої в стандартах світової практики щодо управління ризиками;
- 2) застосування методів якісного аналізу господарських ризиків;
- 3) виконання кількісної оцінки господарських ризиків;
- 4) здійснення вибору інструментів оптимізації ризикових ситуацій.

1.3. Кількість кредитів 3

1.4. Загальна кількість годин 90

1.5. Характеристика навчальної дисципліни	
за вибором	
Денна форма навчання	Заочна (дистанційна) форма навчання
Рік підготовки	
4-й	4-й
Семестр	
7-й	7-й
Лекції*	
32 год.	8 год.
Практичні, семінарські заняття*	
16 год.	Год.
Лабораторні заняття	
год.	Год.
Самостійна робота*	
16 год.	56 год.
Навчально-дослідне завдання	
26 год.	

*Розподіл на лекції, практичні заняття, самостійну роботу може змінюватися в межах 10% загальної кількості годин в залежності від зміни графіку навчального процесу внаслідок святкових і вихідних днів, а також з метою врахування особливостей засвоєння матеріалу конкретною групою студентів для досягнення запланованих результатів навчання.

1.6. Заплановані результати навчання

знати:

- основні поняття, терміни, стандарти управління ризиками,
- загальні принципи аналізу ризикових ситуацій,
- методи і процедури управління ризиками;

вміти:

- діагностувати ризикові ситуації;
- ідентифікувати ризики;
- виокремлювати ризикопороджуючі чинники;
- оцінювати розмір повних витрат, пов'язаних з ризиком;
- визначати ймовірність реалізації ризикопороджуючих чинників;
- установити релевантний ризиковий спектр;
- розробляти дизайн стратегії управління ризиками і напрями її реалізації;
- оцінювати діючу систему ризик менеджменту господарюючого суб'єкту, готувати пропозиції з її удосконалення.

2. Тематичний план навчальної дисципліни

Розділ 1. Вступ в управління ризиками.

Тема 1. Невизначеність- як істотна ознака сучасної економіки

Історія включення невизначеності в науковий дискурс. Междисциплінарні підходи дослідження невизначеності. Типи і види невизначеності.

Тема 2 Господарські ризики і методи їх дослідження.

Ризик як різновид невизначеності. Методичні основи аналізу ризику. Міжнародні стандарти щодо управління ризиками

Розділ 2. Якісний аналіз ризиків

Тема 3. Якісний аналіз ризиків.

Чинники ризику. Класифікація господарських ризиків. Розкладання складних ризиків на прості ризики.

Розділ 3. Зміст кількісної оцінки ризику.

Тема 4. Кількісна оцінка ризику.

Характеристика витрат на ризик. Методи оцінки ймовірності витрат. Визначення допустимого рівня ризику для фірми.

Тема 5. Статистичний і експертний методи аналізу ризиків.

Визначення абсолютного і відносного ризику. Організація експертних процедур для вимірювання ризиків.

Тема 6. Аналітичні методи оцінки ризику.

Кредитні ризики. Процентні ризики. Валютні ризики.

Інвестиційні ризики. Маркетингові ризики.

Розділ 4. Організація управління ризиком.

Тема 7. Відношення господарюючих суб'єктів до ризику.

Особливості ухвалення рішень в умовах ризику: фундаментальний і когнитивний підходи.

Тема 8. Інституціоналізація засобів адаптації до ризику.

Стратегії управління ризиком. Організація управління ризиком.

Тема 9. Відмінні ознаки сучасного ризик менеджменту.

Етапи розвитку процесу управління ризиками. Сучасні методи і технології ризик менеджменту.

3. Структура навчальної дисципліни

Назви розділів	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
Розділ 1. Вступ в управління ризиками.												
Разом за розділом 1	8	4	2			2		2				
Розділ 2. Якісний аналіз ризиків												
Разом за розділом 2	8	4	2			2		2				
Розділ 3. Зміст кількісної оцінки ризику.												
Разом за розділом 3	40	20	10			10		2				
Розділ 4. Організація управління ризиком.												
Разом за розділом 4	6	2	2			2		2				
Захист ІНДЗ	2	2										
Усього годин	90	32	16		26	16		8			26	56

4. Тематики практичних занять

№ з/п	Назва теми	Кількість годин
1	Господарські ризики і методи їх дослідження	2
2	Якісний аналіз ризиків.	2
3	Кількісна оцінка ризику.	2
4	Статистичний і експертний методи аналізу ризиками	2
5	Аналітичні методи оцінки ризику.	6
6	Відмінні ознаки сучасного ризик менеджменту	2
	Разом	16

5. Завдання для самостійної роботи

№ з/п	Назва теми	Кількість годин	Форма контролю
1	Опрацювати доповідь Групи організацій Світового банку Доклада о мировом развитии: Риски и возможности –	2	відповідь на практичних заняттях
2	Опрацювати доповідь Всесвітнього економічного форуму «Глобальні ризики Доповідь 2016»	6	відповідь на практичних заняттях
3	Опрацювати матеріали Федерації європейських ризик-менеджмент асоціацій	2	відповідь на практичних заняттях
4	Опрацювати Національний стандарт Керування ризиком. Методи загального оцінювання ризику	6	відповідь на практичних заняттях ІНДЗ
	Разом	16	

6. Навчально-дослідне завдання

етапи	Очікувані результати
1-й етап дослідницький	Класифікація актуальних ризикопороджуючих чинників
2-й етап аналітичний	Визначення релевантного ризикового спектру
3-й етап проектний	Узагальнення засобів оптимізації ризиків і вибір стратегії управління ризиками

7. Методи контролю

Для діагностики рівня підготовки застосовуються:

- тести,
- ситуаційні завдання
- задачі
- аудиторні контрольні роботи (1- т.3; 2.1.-т.4,5; 2.2.-т.6)
- виконання семестрової навчально-дослідної контрольної роботи.

Оцінка успішності студента з дисципліни виставляється за багатобальною шкалою і складається з суми балів поточної успішності (максимально 60 б. і підсумкового контролю –максимально 40 б.

8. Схема нарахування балів

Поточний контроль та самостійна робота						ІДЗ	Разом	Екзамен/Залік	Сума
Розділ 1	Розділ 2	Розділ 3			Розділ 4				
T1	T2	T3	T4	T5	T6	T7	T8	T9	
10		20			10		20		100
						30	40		

T1, T2 ... T9 – теми розділів.

Шкала оцінювання

Сума балів за всі види навчальної діяльності протягом семестру	Оцінка	
	За 4-х бальною	За 2-х бальною
90 – 100	відмінно	зараховано
70-89	добре	
50-69	задовільно	
1-49	незадовільно	не зараховано

9. Рекомендована література

Основна література

1. Коломієць Г.М. Ризикологія Навчальний посібник Х.2010

Допоміжна література

2. Бланк И.А. Управление финансовыми рисками. Уч.курс.-К.:Ника-Центр,2006.-448с.
3. Вітлінський В.В.,Великоіваненко Г.І. Ризикологія в економіці та підприємстві. – К.:КНЕУ, 2004.-480с.
4. Гринатуров В. М., Шевчук О. Б. «Ризики п/п діяльності», 2000

5. Комплексный подход к риск-менеджменту: стоит ли этим заниматься: Пер с англ. – М.:Изд.дом «Вильямс»,2003. – 208с.
6. Кондрашихін А. Б. «Теорія та практика підприємницького ризику: навч. Посібник» 2009.
7. Нікбахт Е., Гроппеллі А. Фінанси/ К., 1993
8. Риск-менеджмент: Учебник/В.Н.Вяткин,И.В.Вяткин,...-М.,Дашков и К⁰,2003. -512с.
9. Рэдхэд, Хьюз. Управление финансовыми рисками/
10. Сахарцева І. І. «Ризики економічної діагностики підприємства: навч. Посібник» 2008
11. Старостіна А. О. «Ризик-менеджмент: теорія та практика: навч. Посібник» 2009
12. Управление риском. Риск. Устойчивое развитие. Синергетика. - М.:Наука, 2000,-431с.
13. Шегда А.В., Голованенко М.В. Ризики в підприємстві: оцінювання та управління: навч.посібник/ А.В. Шегда, М.В. Голованенко; за ред. А.В. Шегди.- К.:Знання, 2008. - 271с.
14. Эддоус, Стэнсфилд. Методы принятия решений/ М., 1997

Інформаційні ресурси

1. Офіційний сайт Державна служба статистики України [Електронний ресурс] / Режим доступу: <http://www.ukrstat.gov.ua>
2. Харківська обласна державна адміністрація <http://kharkivoda.gov.ua/>
3. Офіційний сайт Головного управління статистики у Харківській області [Електронний ресурс] / Режим доступу: <http://kh.ukrstat.gov.ua/>
4. Компаньон online [Електронний ресурс] / Режим доступу:<http://www.companion.ua/>
5. РБК-Украина Информационное агентство [Электронный ресурс] / Режим доступа: <http://www.rbc.ua/>
6. **Всесвітня організація туризму** - www.world-tourism.org
7. **Всесвітній економічний форум** - www.weforum.org
8. **Група Світового банку** - www.worldbank.org
9. **Державна митна служба України** - www.customs.gov.ua
10. **Державний інформаційно-аналітичний центр моніторингу зовнішніх товарних ринків «Держзовнішінформ»** - www.ukrdzi.com
11. **Організація економічного співробітництва та розвитку (ОЕСР)** -www.oecd.org
12. **Організація Об'єднаних Націй з питань освіти, науки і культури (ЮНЕСКО)** - www.unesco.org
13. **Статистична організація Європейської Комісії (Євростат)** - epp.eurostat.ec.europa.eu
14. **Організація Об'єднаних Націй (ООН)** - www.un.org
15. **Каталог «Імпорттери та експорттери України»** - www.eximbase.com
16. **Конференція ООН з торгівлі і розвитку (ЮНКТАД)** - www.unctad.org
17. **Міжнародна торговельна палата (МТП)** - www.iccwbo.org
18. **Міжнародний валютний фонд (МВФ)** - www.imf.org
19. **Комісія ООН з права міжнародної торгівлі (ЮНСІТРАЛ)** -www.uncitral.org
20. **Урядовий портал Кабінету Міністрів України** - www.kmu.gov.ua
21. **Світова організація торгівлі (СОТ)** - www.wto.org
22. **Федерація національних асоціацій ризик-менеджменту** <http://www.ferma.eu/>

