

Міжнародний європейський університет



КАФЕДРА _____
менеджменту та економіки _____



2021
SYLLABUS
ДОДАТОК 1

Дисципліна

Ризик-менеджмент

Сторінка дисципліни

<https://business.ieu.edu.ua/>

Форма підсумкового контролю

залік

диференційований
залік

екзамен



1 Коротка анотація дисципліни

Вивчення курсу базується на концепціях і поняттях з теорії управління, менеджменту, фінансового та інвестиційного менеджменту, системного аналізу. Структура курсу передбачає детальне вивчення ключових категорій управління ризиком: поняття та види ризиків; суть ризик-менеджменту; методи аналізу та оцінки ризиків; аналіз чутливості; аналіз сценаріїв; імітаційне моделювання Монте-Карло; інтегральна оцінка ризиків; фінансування ризиків; страхування; самострахування; оцінка ефективності методів управління ризиком; оцінка економічної ефективності страхування ризиків.

2 Передумова вивчення дисципліни

Предметом вивчення навчальної дисципліни є процеси управління ризиками в діяльності підприємств.

3 Мета та цілі дисципліни

Метою викладання навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент» є формування системи знань про предмет і суть ризик-менеджменту, його місце в діяльності підприємств і вироблення практичних навичок аналізу ризиків на підприємстві в цілому та в різних його підрозділах, розуміння можливостей ризик-менеджменту для підвищення ефективності підприємств будь-якого рівня.

4 Результати навчання

ПРН 3. Демонструвати знання теорій, методів і функцій менеджменту, сучасних концепцій лідерства.

ПРН 4. Демонструвати навички виявлення проблем та обґрунтування управлінських рішень.

ПРН 16. Демонструвати навички самостійної роботи, гнучкого мислення, відкритості до нових знань, бути критичним і самокритичним.

ПРН 17. Виконувати дослідження індивідуально та/або в групі під керівництвом лідера.

5 Кредити ECTS

На вивчення навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент» відводиться 120 години 4 кредити ЄКТС.

6 Структура дисципліни

Найменування тем	Вид занять / год		
	Лекції	Семінарські заняття / практичні / лабораторні	Самостійна робота
Тема 1. Невизначеність в економіці та природа виникнення ризику	2	-	6
Тема 2. Класифікація видів ризику	2	2	6
Тема 3. Фактори ризику та його функції	2	-	6
Тема 4. Оцінка ризику: інструменти, моделі та методи	2	2	6
Тема 5. Кількісні та якісні методи оцінки ризиків	2	-	6
Контрольна робота №1	2	-	2
Тема 6. Ризик-менеджмент: сутність, зміст, принципи	2	2	6
Тема 7. Стратегія та методи ефективного ризик-менеджменту як інструмента розвитку	2	-	7
Тема 8. Ризик-менеджмент в підприємницькій діяльності	2	2	6
Тема 9. Національний рівень ризик-менеджменту	2	-	7
Тема 10. Ризик-менеджмент у міжнародному бізнесі	2	2	6
Тема 11. Регулювання та зниження ризиків	2	2	6
Тема 12. Роль страхування в управлінні ризиками	2	2	6
Контрольна робота №2	2	-	2

7 Перелік обов'язкових завдань

Обов'язкові завдання	Кінцеві терміни підготовки
Невизначеність в економіці та природа виникнення ризику	За розкладом
Класифікація видів ризику	За розкладом
Фактори ризику та його функції	За розкладом
Оцінка ризику: інструменти, моделі та методи	За розкладом

Кількісні та якісні методи оцінки ризиків	За розкладом
Ризик-менеджмент: сутність, зміст, принципи	За розкладом
Стратегія та методи ефективного ризик-менеджменту як інструмента розвитку	За розкладом
Ризик-менеджмент в підприємницькій діяльності	За розкладом
Національний рівень ризик-менеджменту	За розкладом
Ризик-менеджмент у міжнародному бізнесі	За розкладом
Регулювання та зниження ризиків	За розкладом
Роль страхування в управлінні ризиками	За розкладом

8 Перелік вибіркових завдань

Вибіркові завдання	Кінцеві терміни підготовки
1. Природа та сутність економічних ризиків. 2. Зовнішні та внутрішні фактори ризику. 3. Принципи оцінювання ризику. 4. Правила вибору варіанта рішення в ситуаціях ризику. 5. Статистичний підхід до оцінювання ризику. 6. Методи впливу на ризик. 7. Аналітичні методи оцінювання ризику. 8. Метод аналізу чутливості. 9. Метод визначення точки беззбитковості. 10. Метод корегування параметрів проекту. 11. Метод доцільності витрат. 12. Експертні та евристичні процедури оцінювання ризику. 13. Особливості оцінювання рівня ризику та надійності системи. 14. Особливості застосування теорії статистичних рішень при мінімізації ризиків. 15. Застосування критеріїв прийняття рішень в умовах невизначеності. 16. Загальна схема управління ризиками. 17. Диверсифікація – метод управління ризиками. 18. Самострахування та страхування ризиків. 19. Оцінювання ризику на основі аналізу фінансового стану підприємства. 20. Реалізація прийомів зниження ступеня ризику. 21. Прийоми зниження ступеня ризику. 22. Імовірнісний метод оцінки ризику. 23. Мінімізація ризиків шляхом формування оптимального портфеля цінних паперів. 24. Теорія ризиків і теорія ігор. 25. Ризики в підприємництві. 26. Облік ризику при прийнятті управлінських рішень. 27. Оцінка економічного ризику на основі аналізу фінансової діяльності підприємства. 28. Аналіз ризику на основі прибутковості підприємства. 29. Розробка заходів, які пом'якшують вплив ризикованих ситуацій у діяльності підприємств. 30. Формування стратегії ризик-менеджменту.	За розкладом

9 Ознаки дисципліни

Термін викладання	Семестр	Міждисциплінарна інтеграція	Курс (рік навчання)	Цикл: загальної підготовки / професійної підготовки / вільного вибору
Один семестр	7 семестр	так	4-й курс	Цикл вільного вибору

10 Технічне й програмне забезпечення / обладнання

Мобільні пристрої дозволяється використовувати лише під час on-line тестування та підготовки практичних завдань під час заняття.

Списування під час контрольних робіт заборонено (в т.ч. із використанням мобільних девайсів)

11 Система оцінювання та вимоги

Оцінювання окремих видів виконаної студентом навчальної роботи з дисципліни «Ризик-менеджмент» здійснюється в балах відповідно до табл.1.

Таблиця 1

Розподіл балів оцінювання успішності студентів з навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент»

Розділ I														Розділ II Підсумковий контроль	Всього
Поточне тестування та самостійна робота															
Змістовий розділ 1						Змістовий розділ 2									
T1	T2	T3	T4	T5	KP1	T6	T7	T8	T9	T10	T11	T12	KP2		
-	4	4	4	4	10	-	4	4	4	4	4	4	10	40	100

*T1, T2, ..., T12 – теми занять

**KP1, KP2 – контрольні роботи

Виконані види навчальної роботи зараховуються студенту, якщо він отримав за них позитивну рейтингову оцінку.

Поточне оцінювання знань студентів проводиться протягом семестру у наступних формах: усного опитування студентів на практичних заняттях та оцінки рівня їх знань; перевірки правильності розв'язання практичних задач; експрес-опитування (в усній чи письмовій формі).

Результати поточного контролю знань студентів в цілому (за усіма формами робіт) оцінюються в діапазоні від **0** до **60** балів. Студент допускається до підсумкового контролю за умови виконання вимог навчальної програми та у разі, якщо за поточну навчальну діяльність він набрав не менше **36** балів. Підсумкове оцінювання знань студентів проводиться у формі **заліку**. Максимальна кількість балів, яку можна отримати на іспиті складає **40** балів (див. табл. 2).

Таблиця 2

Розподіл балів оцінювання при підсумковому контролі з навчальної дисципліни

Оцінка в балах за поточне оцінювання	Оцінка в балах за підсумкове оцінювання	Оцінка за національною шкалою
54-60	36-40	Відмінно
45-53	30-35	Добре
36-44	24-29	Задовільно
менше 36	менше 24	Незадовільно

З урахуванням вищевикладеного результати заліку оцінюються в діапазоні від **0** до **40** балів для студентів. При цьому, якщо відповіді студента на заліку оцінені менше ніж на 30%, він отримує незадовільну оцінку за результатами заліку та незадовільну загальну підсумкову оцінку. Загальна підсумкова оцінка з дисципліни складається з суми балів за результати поточного контролю знань та за виконання завдань, що виносяться на залік.

Загальна підсумкова оцінка не може перевищувати **100 балів**.

Загальна підсумкова оцінка в балах, за національною шкалою та за шкалою ECTS заноситься до заліково-екзаменаційної відомості, навчальної картки та залікової книжки студента (див. табл. 3).

Таблиця 3

Шкала оцінювання: національна та ECTS

Сума балів за всі види навчальної діяльності	Оцінка ECTS	Оцінка за національною шкалою	
		для екзамену, курсового проєкту (роботи), практики	для заліку
90-100	A	відмінно	зараховано
82-89	B	добре	
74-81	C		
66-73	D	задовільно	
60-65	E		
30-59	FX	незадовільно з можливістю повторного складання	не зараховано з можливістю повторного складання
1-29	F	незадовільно з обов’язковим повторним вивченням дисципліни	не зараховано з обов’язковим повторним вивченням дисципліни

12 Політика дисципліни

- курс передбачає роботу в колективі,
- середовище в аудиторії є дружнім, творчим, відкритим до конструктивної критики,
- усі завдання, передбачені програмою, мають бути виконані у встановлений термін,
- відвідування занять є обов'язковим компонентом оцінювання.

13 Політика щодо пропусків занять

- студент, який спізнився більше ніж на 15 хв, вважається таким, що пропустив заняття з неповажної причини з обов'язковим відпрацюванням заняття, і при цьому має право бути присутнім на заняття,
- за об'єктивних причин (наприклад, хвороба, міжнародне стажування тощо), навчання може відбуватись в дистанційному режимі за погодженням із керівником курсу та презентувати виконані завдання під час консультації

14 Політика щодо виконання завдань пізніше встановленого терміну

Роботи, які здаються із порушенням термінів без поважних причин, оцінюються на нижчу оцінку (75% від можливої максимальної кількості балів за вид діяльності балів). Перескладання контрольних робіт відбувається із дозволу директорату за наявності поважних причин

15 Політика дотримання академічної доброчесності

Учасники освітнього процесу керуються принципами академічної доброчесності в Міжнародному європейському університеті згідно з Кодексом академічної доброчесності науково-педагогічних, наукових, педагогічних працівників та здобувачів вищої освіти Міжнародного європейського університету – <https://ieeu.edu.ua/pro-mieu/publicna-informatsiia>

16 Рекомендовані джерела інформації

1. Мороз В.М., Мороз С.А. Ризик-менеджмент. – К.: Кондор, 2019. – 140 с. (схеми).
2. Загурський О.М. Управління ризиками. – К.: Вид-во «Університет «Україна»», 2016. – 244 с.
3. Донець Л.І., Шепеленко О.В., Баранцева С.М., Сергєєва О.В., Веремейчик О.Ф. Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків. Навчальний посібник. / За заг. ред. Л.І.Донець. – К.: Центр учбової літератури, 2012. – 472 с.
4. Кондрашихін А.Б., Пепа Т.В. Теорія та практика підприємницького ризику. – К.: Центр навчальної літератури, 2009. – 224 с.
5. Белов П.Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч.: Учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / П.Г.Белов. – Люберцы: Юрайт, 2016. – 211 с.
6. Керування ризиком. Методи загального оцінювання ризику (ІЕС/ISO 31010:2009, IDT). ДСТУ ІЕС/ISO 31010:2013. – К.: Мінекономрозвитку України, 2015. – 73 с.
7. 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. – 271 с.
8. Івченко І.Ю. Економічні ризики: Навчальний посібник. – К.: «Центр навчальної літератури», 2004. – 304 с.
9. Асват Дамодаран. Стратегический риск-менеджмент: принципы и методики.: Пер. с англ. – М.: ООО «И.Д.Вильямс», 2010. – 496 с.: ил. – Парал. тит. англ.

10. Останкова Л.А., Шевченко Н.Ю. Аналіз, моделювання та управління економічними ризиками. – К.: «Центр навчальної літератури», 2011. – 256 с.
11. Сорока П.М., Сорока Б.П. Аналіз, моделювання та управління ризиками. – К.: Відкритий міжнародний університет розвитку людини «Україна», 2011. – 270 с. (таблиці, схеми).
12. Лук'янова В.В., Головач Т.В. Економічний ризик. Навчальний посібник. – К.: Видавничий центр «Академія», 2007. – 464 с. (серія «Альма-матер»).
13. Круи М. Основы риск-менеджмента / М.Круи, Д.Галэй, Р.Марк. – М.: Юрайт, 2017. – 392 с.
14. Банківські ризики: теорія та практика управління: монографія / Л.О.Примостка, О.В.Лисенюк, О.О.Чуб; Мін-во освіти і науки України, ДВНЗ «КНЕУ» ім. Вадима Гетьмана». – К.: КНЕУ, 2015. – 456 с.

17 Поради з успішного навчання на курсі

Якщо Ви бажаєте бути успішним в цій дисципліні, то необхідно бути студентом, який наполегливий, уважний та допитливий, стресостійкий та з почуттям гумору, креативний та життєрадісний!

**Тому я бажаю всім Вам завзятості, цілеспрямованості і оптимізму ;-)
і тоді успіх прийде сам! До зустрічі!**