

SYLLABUS

INTERNATIONAL EUROPEAN
UNIVERSITY



EUROPEAN SCHOOL
OF BUSINESS

Ризик-
менеджмент

2021



SYLLABUS



Дисципліна				
			Ризик-менеджмент	
Викладач (-і)				
				
Профайл викладача (-ів)				
			https://business.ieu.edu.ua/pro-yemsh/struktura-kafedry-vykladachi/kafedry/kafedra-menedzhmentu	
Консультації				
Очні консультації		Другий та третій вівторок місяця з 15:00 до 17:00		
Онлайн консультації		Другий та третій четвер місяця з 16:00 до 17:00		
Контактний телефон				
				
E-mail				
				
Сторінка дисципліни				
			https://business.ieu.edu.ua/	
Форма підсумкового контролю	залік	диференційований залік	екзамен	
	☒	☐	☐	



SYLLABUS



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

4 кредити ЕСТС - 120 академічних годин

6 Структура дисципліни

Найменування тем	Вид занять/год		
	Лекції	Практичні заняття	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

6 Структура дисципліни

Найменування тем	Вид занять/год		
	Лекції	Практичні заняття	Самостійна робота
Тема 5. Кількісні та якісні методи оцінки ризиків	2		6
<i>Контрольна робота №1</i>	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
<i>Контрольна робота №2</i>	2		2

7 Перелік обов'язкових завдань

Невизначеність в економіці та природа виникнення ризику
 Класифікація видів ризику
 Фактори ризику та його функції
 Оцінка ризику: інструменти, моделі та методи
 Кількісні та якісні методи оцінки ризиків
 Ризик-менеджмент: сутність, зміст, принципи
 Стратегія та методи ефективного ризик-менеджменту як інструмента розвитку
 Ризик-менеджмент в підприємницькій діяльності
 Національний рівень ризик-менеджменту
 Ризик-менеджмент у міжнародному бізнесі
 Регулювання та зниження ризиків
 Роль страхування в управлінні ризиками

8 Перелік вибірових завдань

1. Природа та сутність економічних ризиків.
2. Зовнішні та внутрішні фактори ризику.
3. Принципи оцінювання ризику.
4. Правила вибору варіанта рішення в ситуаціях ризику.

8 Перелік вибірових завдань

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 підприємстві.
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.

9 Ознаки дисципліни

Термін викладання	Семестр	Міжнародна дисциплінарна інтеграція	Курс (рік навчання)	Цикли: загальної підготовки/ професійної підготовки/ вільного вибору
1 семестр	7 семестр	Так	4 курс	Цикл професійної підготовки

10 Система оцінювання та вимоги

У процесі вивчення дисципліни здійснюється поточний та підсумковий контроль знань студентів. Підсумкова залікова оцінка виставляється відповідно до сумарного рейтингу студента.

Загальна система оцінювання

За результатами поточного контролю протягом семестру студент може отримати максимально – 100 балів, мінімальна сума балів, що дозволяє студенту бути атестованим з дисципліни – 60 балів.

Співвідношення між національними та ECTS оцінками і рейтингом студента:

<https://ieu.edu.ua/docs/pol-mark-esb.pdf>



SYLLABUS



11 Умови допуску до підсумкового контролю

Мінімальна кількість балів, яку повинен набрати здобувач освіти за поточну навчальну діяльність за семестр для допуску до підсумкового контролю – 36 балів. Оцінка за дисципліну визначається як сума підсумкового балу за поточну діяльність та балу за підсумковий контроль і виражається за багатобальною шкалою.

Оцінка з дисципліни, яка завершується екзаменом, визначається як сума балів за поточну навчальну діяльність (не менше 36), бали за індивідуальну самостійну роботу здобувача освіти (не більше 6) та балів за екзамен (не менше 24).

Загальна бал з дисципліни становить 100. Сумарна оцінка за вивчення дисципліни виставляється за національною та європейською шкалою.

Підсумковий контроль у формі заліку проводиться після завершення вивчення усіх тем дисципліни і складається здобувачами освіти у період екзаменаційної сесії.

<https://ieu.edu.ua/docs/050.pdf>

12 Політика дисципліни

Для продуктивної навчально-пізнавальної діяльності студентів при вивченні дисципліни здійснюються актуальні лекції та семінари спрямовані на повне та точне розкриття навчального матеріалу. Для засвоєння навчальної дисципліни студенти повинні відвідувати всі заняття передбачені навчально-тематичним планом, виконувати практичні завдання та самостійно готуватися і освоювати новий матеріал. Студенти повинні активно та наполегливо працювати, бути відкритими до нових завдань.

Викладачі обов'язково повинні повідомити студентів про методи поточного та підсумкового контролю, політику відпрацювання пропущених занять та виконання завдань пізніше встановленого терміну. Викладачі не можуть дозволяти жодного прояву корупції, нетолерантності чи необ'єктивності.

13 Політика щодо пропусків занять та виконання завдань пізніше встановленого терміну

Студент, який з поважних причин, підтверджених документально, не підлягав поточному контролю має право пройти поточний контроль у двотижневий термін після повернення до навчання.

Студент, що був відсутній на заняттях без поважних причин, не брав участі у заходах поточного контролю, не ліквідував академічну заборгованість, не допускається до підсумкового семестрового контролю знань з цієї дисципліни, а в день складання екзамену в екзаменаційній відомості науково-педагогічним працівником виставляється оцінка «недопущений». Повторне складання екзамену з дисципліни призначається за умови виконання всіх видів навчальної, самостійної (індивідуальної) роботи, передбачених робочою навчальною програмою дисципліни, і проводиться згідно із затвердженим директором графіком ліквідації академічної заборгованості.

<https://ieu.edu.ua/docs/050.pdf>

14 Політика дотримання академічної доброчесності

Учасники освітнього процесу керуються принципами академічної доброчесності

<https://ieu.edu.ua/docs/011.pdf>



SYLLABUS



15

Рекомендовані джерела інформації

Мороз В.М., Мороз С.А. Ризик-менеджмент. – К.: Кондор, 2019. (схеми).
Загурський О.М. Управління ризиками. – К.: Вид-во «Університет “Україна”», 2016.
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.
Кондрашихін А.Б., Пепа Т.В. Теорія та практика підприємницького ризику. – К.: Центр навчальної літератури, 2009.
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.

16

Поради з успішного навчання на курсі

Якщо Ви бажаєте бути успішним в цій дисципліні, то:

- визначте свою мету;
- складіть собі чіткий графік;
- наполегливо працюйте;
- будьте впевненим і свідомим;
- будьте креативним і активним.

Середовище в аудиторії повинно бути дружнім, творчим, відкритим до конструктивної критики. На аудиторні заняття слухачі мають з'являтися вчасно відповідно до діючого розкладу занять, яке міститься на сайті університету. Під час занять усі його учасники мають дотримуватися вимог техніки безпеки.

Бажаю Вам завзятості, цілеспрямованості і оптимізму. І тоді успіх прийде сам!
До зустрічі на заняттях!