

SYLLABUS

INTERNATIONAL EUROPEAN
UNIVERSITY



EUROPEAN SCHOOL
OF BUSINESS



SYLLABUS



Course Name 

 Ризик-менеджмент

Lecturer (s) 

 Ремига Юлія Сергіївна, кандидат економічних наук, доцент, професор кафедри менеджменту, фінансів та бізнес адміністрування

Lecturer's profile 

 <https://business.ieu.edu.ua/pro-yemsh/struktura-kafedry-vykladachi/kafedry/kafedra-menedzhmentu#zzz-001>

Consultations

online consulting  —

offline consulting  Понеділок 11:00-13:00

Contact number 

 +380 67 705 54 21

E-mail 

 yuliiaremyha@ieu.edu.ua

Discipline page 

 <https://business.ieu.edu.ua/navchannia/orhanizatsiia-osvitnoho-protsesu/robochi-prohramy/bakalavrat>

Form of final control

test

def. test

exam





SYLLABUS



1 Коротка анотація дисципліни

Вивчення курсу з дисципліни «Ризик-менеджмент» 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

2 Передумова вивчення дисципліни

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.

Основні цілі вивчення дисципліни «Ризик-менеджмент»:

- формування системи знань про поняття та зміст ризик-менеджменту;
- оволодіння особливостями системного та операційного підходів в логістиці;
- розкриття поняття ризику;
- вивчення основних принципів ризик-менеджменту;
- вивчення основ запобігання ризикам;
- розкриття змісту програми ризик-менеджменту на підприємстві;
- вміння складати програму ризик-менеджменту в рамках усього підприємства та у сфері міжнарод-

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 ECTS / 120 академічних годин

Назви змістових розділів і тем	Кількість годин											
	денна форма						заочна форма					
	усього	у тому числі					усього	у тому числі				
		л	п	сем.	інд.	с.р.		л	п	сем.	інд.	с.р.
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Змістовий розділ 1. Теоретичні засади економічного аналізу												
Тема 1. Невизначеність в економіці та природа виникнення ризику	8	2	-	-	-	6	10	2	-	-	-	8
Тема 2. Класифікація видів ризику	10	2	2	-	-	6	10	-	-	-	-	10
Тема 3. Фактори ризику та його функції	8	2	-	-	-	6	10	-	-	-	-	10
Тема 4. Оцінка ризику: інструменти, моделі та методи	10	2	2	-	-	6	10	-	0	-	-	10
Тема 5. Кількісні та якісні методи оцінки ризиків	8	2	-	-	-	6	10	-	2	-	-	8
Контрольна робота №1	4	2	-	-	-	2	-	-	-	-	-	-
Разом за змістовим розділом 1	48	12	4	-	-	32	50	2	2	-	-	46
Змістовий розділ 2. Аналіз господарської діяльності (управлінський аналіз)												
Тема 6. Ризик-менеджмент: сутність, зміст, принципи	10	2	2	-	-	6	10	2	-	-	-	8
Тема 7. Стратегія та методи ефективного ризик-менеджменту як інструмента розвитку	9	2	-	-	-	7	10	-	-	-	-	10
Тема 8. Ризик-менеджмент в підприємницькій діяльності	10	2	2	-	-	6	10	-	-	-	-	10
Тема 9. Національний рівень ризик-менеджменту	9	2	-	-	-	7	10	-	-	-	-	10
Тема 10. Ризик-менеджмент у міжнародному бізнесі	10	2	2	-	-	6	10	-	-	-	-	10
Тема 11. Регулювання та зниження ризиків	10	2	2	-	-	6	10	-	-	-	-	10
Тема 12. Роль страхування в управлінні ризиками	10	2	2	-	-	6	10	-	-	-	-	10
Контрольна робота №2	4	-	-	-	-	2	-	-	-	-	-	-
Разом за змістовим розділом 2	72	16	10	-	-	46	70	2	-	-	-	68
Усього годин	120	28	14	-	-	78	120	4	2	-	-	114



SYLLABUS



7

Перелік обов'язкових завдань

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

8

Перелік вибірових завдань

1. Правила вибору варіанта рішення в ситуаціях ризику.
2. Методи впливу на ризик.
3. Метод аналізу чутливості.
4. Метод визначення точки беззбитковості.
5. Метод доцільності витрат.
6. Експертні та евристичні процедури оцінювання ризику.
7. Особливості застосування теорії статистичних рішень при мінімізації ризиків.
8. Загальна схема управління ризиками.
9. Теорія ризиків і теорія ігор.
10. Облік ризику при прийнятті управлінських рішень.
11. Аналіз ризику на основі прибутковості підприємства.
12. Формування стратегії ризик-менеджменту.

9

Ознаки дисципліни

Термін викладання	Семестер	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. Загальна система оцінювання дисципліни

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

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

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 ЄКТС оцінками і рейтингом студента: QR Code: <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 заліком, визначається як сума балів за поточну навчальну діяльність (не менше 36), бали за індивідуальну самостійну роботу здобувача освіти (не більше 6) та балів за залік (не менше 24).

Загальний 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 залікової сесії.

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

12 Політика дисципліни

Для продуктивної навчально-пізнавальної діяльності студентів при вивченні дисципліни здійснюються актуальні лекції та семінари у вигляді презентацій, робота в групах, семінарів-дискусій.

На заняттях та під час перебування в університеті студент повинен поважно ставитися до викладачів, співробітників та інших студентів, відвідувати заняття згідно з розкладом, приходити вчасно і не залишати аудиторії без дозволу викладача. Необхідно виконувати всі академічні завдання і роботи у визначені терміни.

Викладач, у свою чергу повинен постійно підвищувати свій професійний рівень, педагогічну майстерність, загальну культуру, забезпечувати умови для засвоєння студентами навчальних програм на рівні обов'язкових вимог щодо змісту, рівня та обсягу освіти, сприяти всебічному професійному розвитку студентів. Обов'язково дотримуватися навчально-тематичного плану, не спізнюватися на заняття, не допускати жодних проявів корупції, дискримінації, булінгу, цькування та утиску прав здобувачів освіти.

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 іспиту в екзаменаційній відомості науково-педагогічним працівником виставляється оцінка «недопущений». Повторне складання іспиту 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.

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



SYLLABUS



14 Політика дотримання академічної доброчесності

Учасники освітнього процесу керуються принципами академічної доброчесності QR Code: <https://ieu.edu.ua/docs/011.pdf>

15 Рекомендовані джерела інформації

Основна (базова):

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. Керування ризиком. Методи загального оцінювання ризику (IEC/ISO 31010:2009, IDT). ДСТУ IEC/ISO 31010:2013. – К.: Мінекономрозвитку України, 2015. – 73 с.

Допоміжна:

1. 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.
2. Івченко І.Ю. Економічні ризики: Навчальний посібник. – К.: «Центр навчальної літератури», 2004. – 304 с.
3. Останкова Л.А., Шевченко Н.Ю. Аналіз, моделювання та управління економічними ризиками. – К.: «Центр навчальної літератури», 2011. – 256 с.
4. Сорока П.М., Сорока Б.П. Аналіз, моделювання та управління ризиками. – К.: Відкритий міжнародний університет розвитку людини «Україна», 2011. – 270 с. (таблиці, схеми).
5. Лук'янова В.В., Головач Т.В. Економічний ризик. Навчальний посібник. – К.: Видавничий центр «Академія», 2007. – 464 с. (серія «Альма-матер»).
6. 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.

Інформаційні ресурси:

- 1.Офіційний сайт, присвячений кількісним методам ризик- менеджменту «Quantum – Finance in Perspective» // Електронний ресурс. – Режим доступу: <http://www.quantummagazine.com>.
- 2.166AS/NZS Risk Management Standart 4360:1999 // Електронний ресурс. – Режим доступу: <http://www.riskmanagement.com.ua>.
- 3.Managing Risks: A New Framework by Robert S. Kaplan and Anette Mikes // Harvard Business Review // Електронний ресурс. – Режим доступу: <https://hbr.org/2012/06/managing-risks-a-new-framework>.

16 Рекомендовані джерела інформації

Якщо Ви бажаєте успішно засвоїти цей предмет, необхідно бути:

- наполегливим, уважним і допитливим;
- креативним і життєрадісним, відкритим для спілкування та дискусій;
- готовим отримувати інформацію і знання з предмету не лише на лекціях, а й у позааудиторний час.

До зустрічі!