

НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ БІОРЕСУРСІВ І ПРИРОДОКОРИСТУВАННЯ
УКРАЇНИ

ФАКУЛЬТЕТ АГРАРНОГО МЕНЕДЖМЕНТУ

Кафедра адміністративного менеджменту та зовнішньоекономічної діяльності



СИЛАБУС ДИСЦИПЛІНИ

«Ризик-менеджмент»

Ступінь вищої освіти – Бакалавр
Спеціальність 073 «Менеджмент»
Освітня програма - «Менеджмент»
Рік навчання - 4, семестр - 8
Форма навчання – денна, заочна
Кількість кредитів ЄКТС - 3
Мова викладання – українська, англійська

Лектор курсу
Контактна інформація
лектора (e-mail)
Викладач, що веде
практичні заняття
Контактна інформація
викладача (e-mail)
Сторінка курсу в eLearn

Ковтун О.А.
ekovtoun@nubip.edu.ua

Гречанюк Л.М.
ekonomistnmi@ukr.net

<https://elearn.nubip.edu.ua/course/view.php?id=1447>

ОПИС ДИСЦИПЛІНИ

Дисципліна «Ризик-менеджмент» надає практичні навички з ідентифікації, аналізу та оцінки ризиків, розробки методів ефективного управління ризиками в бізнес-середовищі. Курс вивчає методи оцінювання параметрів ризиків, які характеризують кількісні взаємозв'язки між економічними величинами. В результаті вивчення навчальної дисципліни студенти повинні знати: сутність, предмет і об'єкт дисципліни, моделювання економічного ризику, систему економічного прогнозування ризиків, систему соціального прогнозування ризиків, методи технічного аналізу. Другий модуль вивчення дисципліни присвячено опануванню студентами теорії методів прийняття управлінських рішень на основі системного аналізу, математичного моделювання та оптимізації діяльності суб'єктів господарювання в умовах ринкової економіки та їх практичного та прикладного застосування; опрацювання ними на конкретних, максимально наближених до реальних, модельних кейсових завданнях, прикладах і математичних моделях методів визначення оптимальних управлінських рішень, з використанням засобів обчислювальної техніки, пакетів прикладних програм, сучасних інформаційних технологій тощо.

Анотація до курсу

Ризик-менеджмент (або управління ризиком) визначає шляхи і можливості забезпечення стійкості бізнесу, його властивості уникати та протистояти несприятливим ситуаціям.

Засвоєння основних положень курсу «Ризик-менеджмент» відіграє важливу роль у розвитку економічно-управлінського мислення студентів, закладаючи підґрунтя для прийняття економічно виважених рішень щодо проблем, пов'язаних з майбутньою професійною діяльністю.

1. Мета та цілі курсу

Формування системи знань про предмет і суть ризик-менеджменту, його місце в діяльності підприємств і вироблення практичних навичок аналізу ризиків як на мікро-, так і на макрорівні, розуміння можливостей ризик-менеджменту для підвищення ефективності бізнесу та використання методів управління ризиками, які дозволяють обґрунтовувати та приймати оптимальні управлінські рішення в умовах невизначеності.

2. Набуття компетентностей

Компетентності	
Загальні компетентності (ЗК)	
ЗК№3	Здатність до абстрактного мислення, аналізу, синтезу.
ЗК№5	Знання та розуміння предметної області та розуміння професійної діяльності
ЗК№13	Здатність генерувати нові ідеї (креативність)
Фахові компетентності спеціальності (ФК)	
ФК№2	Здатність аналізувати результати діяльності організації, зіставляти їх з факторами впливу зовнішнього та внутрішнього середовища
ФК№3	Здатність визначати перспективи розвитку організації
ФК№4	Вміння визначати функціональні області організації та зв'язки між ними
ФК№12	Здатність аналізувати й структурувати проблеми організації, формувати обґрунтовані рішення

3. Програмні результати навчання

ПРН	Зміст
ПРН№3	Демонструвати знання теорій, методів і функцій менеджменту, сучасних концепцій лідерства.
ПРН№4	Демонструвати навички виявлення проблем та обґрунтування управлінських рішень
ПРН№5	Описувати зміст функціональних сфер діяльності організації
ПРН№6	Виявляти навички пошуку, збирання та аналізу інформації, розрахунку показників для обґрунтування управлінських рішень
ПРН№12	Оцінювати правові, соціальні та економічні наслідки функціонування організації
ПРН№19	Демонструвати здатність самостійного прийняття рішень, розробляти достатню кількість альтернативних варіантів, обирати оптимальні рішення та нести відповідальність за їх реалізацію

4. Розподіл годин

Вид заняття	лекції	практичні заняття	самостійна робота
К-сть годин	15	30	45

5. СТРУКТУРА КУРСУ

Тема	Години (лекції/ практичні роботи/ самостійні роботи)	Результати навчання	Завдання	Оцінювання, бали
7 семестр				
Модуль 1. Ризик як економічна категорія				40
Тема 1 Ризик як економічна категорія. Класифікація ризиків і загальна схема ризик-менеджменту	2/4/2	<p>Знати:</p> <ul style="list-style-type: none"> - понятійний та категорійний апарат ризик-менеджменту; - сутність невизначеності й ризиків та основні фактори, що впливають на ризики, джерела виникнення ризиків; - якісні та кількісні методи оцінки ризиків; – основні закони та принципи ризик-менеджменту; – особливості управління зовнішніми та внутрішніми ризиками <p>Вміти: формувати карту ризиків для підприємства, оволодіти інструментарієм для визначення підприємницького ризику при здійсненні комерційної діяльності за допомогою різних методів та підходів: методу Гаусса, аналізу безбитковості підприємства та визначення ризику, за розмірами можливих збитків, за ймовірністю виникнення незапланованих втрат (методи розглядаються на реальних кейсах)</p>	<p><i>Підготовка до лекцій (попереднє ознайомлення з презентацією та лекцією в eLearn). Виконання завдання на практичних заняттях (в групі та самостійно). Виконання самостійної роботи (в малих групах, самостійно, eLearn). Підготовка та написання модульної контрольної роботи (тестова - в eLearn).</i></p>	<p><i>Виконання та здача індивідуальних завдань.</i></p> <p><i>Модульна тестова робота в eLearn.</i></p> <p><i>Самостійна робота – відповідно до завдань в eLearn.</i></p>
Тема 2 Кількісні методи оцінки ризиків. Карта ризиків	2/4/10			
Тема 3 Величина підприємницького ризику	4/4/8			
Модуль 2. Теорія ігор для оцінки ризику				60
Тема 4. Теорія ігор-оптимізація ризику в умовах конфлікту	2/8/12	<p>Знати. технологію використання теорії ігор при прийнятті управлінських рішень в умовах ризику та невизначеності;</p> <p>– сутність системи управління ризиками</p> <p>Вміти: опанувати практичні навички розробки, обґрунтування та прийняття управлінських рішень в</p>	<p><i>Підготовка до лекцій (попереднє ознайомлення з презентацією та лекцією в eLearn). Виконання завдання на практичних заняттях (в групі та самостійно). Виконання самостійної роботи (в малих групах, самостійно, eLearn). Підготовка та написання модульної контрольної роботи (тестова - в eLearn).</i></p>	<p><i>Виконання та здача індивідуальних завдань.</i></p> <p><i>Модульна тестова робота в eLearn.</i></p> <p><i>Самостійна робота – відповідно до завдань в eLearn.</i></p>
Тема 5. Аналіз рішень. Аналіз чутливості	2/6/8			
Тема 6. Дерева рішень	3/4/5			

		умовах ризику та невизначеності		
Можливість отримання додаткових балів:	Додаткові бали можна отримати за підготовку доповіді та участь в студентській конференції, публікацію статті, участь у 1 турі Всеукраїнської олімпіади			до 10 балів
<i>Всього за 7 семестр</i>	15/30/45	-	-	70 100*0,7 (максимум 70 балів)
Екзамен				30
Всього за курс				100

ПОЛІТИКА ОЦІНЮВАННЯ

Політика щодо дедлайнів та перескладання:	Студент повинен здавати усі роботи у заплановані терміни. За роботи, що здаються із порушенням термінів без поважних причин, знижується бал. Перескладання модульної контрольної роботи відбувається за наявності поважних причин (лікарняний, міжнародне стажування, індивідуальний графік) і дозволяється у терміни до закінчення наступного модульного контролю.
Політика щодо академічної доброчесності:	При виконанні всіх видів навчальних робіт студент повинен дотримуватись політики академічної доброчесності.
Політика щодо відвідування:	Відвідування лекційних та практичних (семінарських) занять є обов'язковим для всіх студентів. За об'єктивних причин, визначених Положенням про навчальний процес НУБіП, навчання може відбуватись відповідно до індивідуального навчального плану, затвердженого у визначеному порядку.

ШКАЛА ОЦІНЮВАННЯ СТУДЕНТІВ

Рейтинг здобувача вищої освіти, бали	Оцінка національна за результати складання екзаменів заліків	
	екзаменів	заліків
90-100	відмінно	зараховано
74-89	добре	
60-73	задовільно	
0-59	незадовільно	не зараховано

РЕКОМЕНДОВАНА ЛІТЕРАТУРА

1. Савчук В.П. Основи ризик-менеджменту підприємств. Дніпро: «Баланс Бізнес Букс», 2019. – 280 с.
2. Савчук В.П. Практическая энциклопедия финансового менеджера. К.: Баланс Бизнес Букс, 2017. – 976 с.
3. Савчук В.П. Оцифрованный менеджмент: Business Intelligence для ТОПов. К.: «Баланс Бизнес Букс», 2018. – 504 с.
4. Старостіна А. О., Кравченко В. А. Ризик-менеджмент: теорія та практика: Навч. посіб. - К.: ІВЦ "Видавництво «Політехніка»", 2004. - 200 с
5. Мороз В.М., Мороз С.А. Ризик-менеджмент: навч.посіб. К: «Кондор», 2019. – 140 с.
3. Останкова Л.А., Шевченко Н.Ю. Аналіз моделювання та управління економічними

ризиками. Навч. посіб. – К.: Центр учбової літератури, 2019 – 256 с.

6. Чернова Г. В. Практика управления рисками на уровне предприятия. - СПб.: Питер, 2000. - 176 с.

Додаткова література

1. Дамордан А. Стратегический риск менеджмент. – М. Вильямс, 2010. – с.
2. Боди З., Кейн А., Маркус А. Принципы инвестиций: Пер. с англ. -4-е изд. - М.: Издат. дом «Вильямс», 2002. - 984 с. «
3. Бююль А., Цефель П. SPSS: искусство обработки информации. Анализ статистических данных и восстановление скрытых закономерностей: Пер. с нем. - СПб.: ООО «ДиаСофтЮП», 2001. - 608 с.
4. Ван Хорн Дж. К., Вахович Джон М. Основы финансового менеджмента: Пер. с англ. - 11-е изд. - М.: Издат. дом «Вильямс». -2001.-992 с.
5. Вітлінський В. В., Наконечний С. /., Шарапов О. Д. Економічний ризик та методи його вимірювання: Підручник. - К.: КНЕУ, 2000. -354 с.
6. Камінський А. Б. Економічний ризик та методи його вимірювання: Навч. посіб. - К.: Вид. дім «Козаки», 2002. - 120 с
7. Мертенс А. Управление рисками бизнеса. К.: МФК, 2011. – 502 с.
8. Малхотра Н. Маркетинговые исследования. Практическое руководство: Пер. с англ. - 3-е изд. - М.: Издат. дом «Вильямс», 2002. -960 с.
10. Моделирование рискованных ситуаций в экономике и бизнесе: Учеб. пособие / А. М. Дубров, Б. А. Лагоша, Е. Ю. Хрусталеv; Под ред. Б. А. Лагоши. - М.: Финансы и статистика, 2000. - 176 с.
11. Рогов М. А. Риск-менеджмент. - М.: Финансы и статистика, 2001. -120 с.
12. Старостина А. А. Маркетинговые исследования. - М.: Издат. дом «Вильямс», 2001. - 284 с.
13. Старостина А. А., Кравченко В. А. Риск-менеджмент в маркетинге // <http://www.4p.com.Ua/som/9.html>
14. Тэпман Л. Н. Риски в экономике: Учеб. пособие для студентов вузов / Под ред. В. А. Швандара. - М.: ЮНИТИ, 2002. - 379 с.
15. www.ebrd.com
16. www.ifc.org
17. Конкурентное преимущество: как достичь высокого результата и обеспечить его устойчивость/ Майкл Портер; Пер.с англ. – 4-е изд. – М.: Альпина Паблишер, 2016 – 716 с.
18. www.palisade.com/risk/
19. www.ferma.eu/
20. <https://www.oracle.com/technetwork/middleware/crystalball/overview/risk-analysis-overview-4367760.pdf>