

СИЛАБУС
з дисципліни «Ризик-менеджмент»
на отримання ступеню вищої освіти «магістр» за спеціальністю
051 «Економіка»
Харківський національний технічний університет
сільського господарства імені Петра Василенка

Обсяг курсу – 3 кредити (ECTS): 24 годин лекції, 24 годин – практичні заняття, 42 годин – самостійна робота, екзамен.

Викладач курсу - **Дудник Олена Василівна**, к.е.н., доцент кафедри організації виробництва, бізнесу та менеджменту. <http://new.khntusg.com.ua/staff/dudnik-olena-vasilivna>

ОПИС КУРСУ

Пререквізити - Базові знання з дисциплін: «Економічна теорія», «Економіка підприємства», «Фінанси підприємства», «Менеджмент», «Інвестування».

Постреквізити. Продовжують вивчення даного предмету наступні дисципліни: «Управління економічною діяльністю», «Інноваційний розвиток підприємства», «Управління проектами».

Коротка анотація дисципліни (загальна характеристика, особливості, переваги).

Навчальна дисципліна «Ризик-менеджмент» **буде корисна** майбутнім висококваліфікованим фахівцям для набуття знань, що дозволять їм ефективно ознайомитись з цілісною за своїм змістом та логічною за послідовністю подання моделлю організації ризик-менеджменту на організаційному рівні. З'ясувати місце та роль підсистеми ризик-менеджменту в системі стратегічного та оперативного управління, а також розглянути її зміст та особливості функціонування на різних етапах життєвого циклу організації.

Сьогодні проблематика управління ризиками все далі частіше перестає розглядатися на рівні вузькопрофільного напрямку професійної діяльності менеджера та стає об'єктом безпосередньої уваги суб'єктів управлінської діяльності незалежно від рівня їх організаційної ієрархії. Така значущість ризик-менеджменту у межах загальної системи управління організацією пов'язана з докорінною зміною акцентів у визначенні об'єктів управлінського впливу, адже сприйняття феномену ризику, виключно через призму негативних наслідків його розвитку, не лише викривлює зміст відповідної категорії, а й стає причиною втрати конкурентних переваг організацією.

Висока імовірність виникнення і розвитку кризи в процесі діяльності будь-якого підприємства зумовлює необхідність здійснення спеціалізованого ризик-менеджменту, який спрямоване на мінімізацію впливу ризику та подолання кризових явищ, базуючись на системному, ситуаційному та процесному підходах.

Вивчення даної дисципліни дає можливість здобувачу вищої освіти:

знати:

- спеціалізований понятійно-категорійний апарат щодо обґрунтування управлінських рішень та оцінювання ризиків, набутий у процесі навчання та професійної діяльності на рівні новітніх досягнень, які є основою для оригінального мислення та інноваційної діяльності, зокрема в контексті дослідницької роботи;

- основні принципи та підходи до обґрунтування управлінських рішень на основі використання сучасних економіко-математичних методів моделювання і оцінювання ризиків в різних умовах функціонування (визначеність, невизначеність, ризик).

вміти:

- приймати управлінські рішення у складних і непередбачуваних умовах, що потребує застосування нових підходів до прогнозування і оцінювання основних ризиків, що впливають на результат підприємницької діяльності;

- розв'язувати складні задачі і проблеми управління на основі обґрунтованого вибору економіко-математичних методів розроблення управлінських рішень, використовуючи комп'ютерну техніку та сучасні програмні засоби з метою ідентифікації, оцінки та аналізу ризиків, що потребує оновлення та інтеграції знань, часто в умовах неповної чи недостатньої інформації та суперечливих вимог.

Мета та основні задачі дисципліни.

Метою викладення дисципліни є формування у студентів системи компетентностей, які необхідні для обґрунтування управлінських рішень з різним ступенем невизначеності та ризику у сучасних умовах трансформаційних перетворень. Вивчення теоретичних і методичних основ процесу прийняття управлінських рішень у професійній діяльності.

Предметом є закономірності планування, створення та ефективного управління підприємствами та організаціями в умовах виникнення ризику діяльності.

Завдання курсу - формування у студентів компетентностей щодо системи знань з теоретично-методичних основ розроблення та прийняття управлінських рішень; компетентностей щодо системи навичок застосування основних принципів обґрунтування різних видів управлінських рішень; здатності до опанування практичними економіко-математичними методами щодо розробки та прийняття управлінських рішень в умовах визначеності, невизначеності та ризику; здатності до оцінки ефективності прийнятих управлінських рішень

Компетентність, що забезпечує. Вивчення дисципліни забезпечує формування у фахівців здатність розв'язувати складні спеціалізовані задачі та практичні проблеми в економічній сфері, які характеризуються комплексністю та невизначеністю умов, що передбачає застосування теорій та методів економічної науки, а також здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу; навички використання інформаційних і комунікаційних технологій; здатність до пошуку, оброблення та аналізу інформації з різних джерел; здатність виявляти знання та розуміння проблем предметної області, основ функціонування сучасної економіки на мікро-, мезо-, макро- та міжнародному рівнях. здатність пояснювати економічні та соціальні процеси і явища на основі теоретичних моделей, аналізувати і змістовно інтерпретувати отримані результати; здатність застосовувати комп'ютерні технології та програмне забезпечення з обробки даних для вирішення економічних завдань, аналізу інформації та підготовки аналітичних звітів. здатність прогнозувати на основі стандартних теоретичних та економетричних моделей соціально-економічні процеси; здатність самостійно виявляти проблеми економічного характеру при аналізі конкретних ситуацій, пропонувати способи їх вирішення; здатність поглиблено аналізувати проблеми і явища в одній або декількох професійних сферах з врахуванням економічних ризиків та можливих соціально-економічних наслідків.

Результати навчання:

ПР 4. Розуміти принципи економічної науки, особливості функціонування економічних систем

ПР 5. Застосовувати аналітичний та методичний інструментарій для обґрунтування пропозицій та прийняття управлінських рішень різними економічними агентами (індивідуумами, домогосподарствами, підприємствами та органами державної влади).

ПР 9. Усвідомлювати основні особливості сучасної світової та національної економіки, інституційної структури, напрямів соціальної, економічної та зовнішньоекономічної політики держави.

ПР 10. Проводити аналіз функціонування та розвитку суб'єктів господарювання, визначати функціональні сфери, розраховувати відповідні показники які характеризують результативність їх діяльності.

ПР 18. Використовувати нормативні та правові акти, що регламентують професійну діяльність.

ПР 21. Вміти абстрактно мислити, застосовувати аналіз та синтез для виявлення ключових характеристик економічних систем різного рівня, а також особливостей поведінки їх суб'єктів.

ПР 22. Демонструвати гнучкість та адаптивність у нових ситуаціях, у роботі із новими об'єктами, та у невизначених умовах.

ПР 23. Показувати навички самостійної роботи, демонструвати критичне, креативне, самокритичне мислення.

Структура курсу

Змістовний модуль 1. «Теоретичні основи ризик-менеджменту»

Лекції:

Тема 1. Ризик і підприємництво

Тема 2. Сутність та принципи концепції ризик-менеджменту

Тема 3. Еволюція світового ризик-менеджменту

Тема 4. Класифікація ризику та основні підходи управління ним

Тема 5. Прийняття оптимальних рішень в умовах невизначеності

Тема 6. Програма управління ризиками на підприємстві

Практичні заняття:

Тема 1. Класифікація ризику та типи поведіння менеджерів (суб'єктів ризику)

Тема 2. Оцінка підприємницького ризику.

Тема 3. Визначення чутливості інвестиційних проектів

Тема 4. Оцінка ефективності інвестиційного проекту (NPV)

Тема 5. Управління ризиком

Тема 6. Визначення ризику статистичним методом

Змістовний модуль 2. «Методологія ризик-менеджменту»

Лекції:

Тема 7. Ризики у виробничому підприємстві

Тема 8. Ризик-менеджмент і маркетинг: сфери перетинання

Тема 9. Фінансовий ризик-менеджмент

Тема 10. Інвестиційні ризики

Тема 11. Система кількісних оцінок ризику

Тема 12. Обґрунтування стратегії ризик-менеджменту суб'єкту господарювання

Практичні заняття:

Тема 7. Оцінка виробничого ризику

Тема 8. Управління ризиком та шляхи його мінімізації

Тема 9. Особливості ризиків у зовнішньоекономічній діяльності

Тема 10. Управління фінансовими ризиками

Тема 11. Ризик-менеджмент у сфері маркетингу

Тема 12. Програма управління ризиками на підприємстві

Політика курсу – жодні форми порушення академічної доброчесності не толеруються. У випадку таких подій – реагування відповідно до Положення про академічну доброчесність учасників освітнього процесу.

Система оцінювання – оцінювання проводиться за 100-бальною шкалою. Бали нараховуються за наступним співвідношенням: **модуль 1** – 30 % семестрової оцінки; **модуль 2** – 30 % семестрової оцінки; **екзамен** – 40 % семестрової оцінки

Інформаційні ресурси

Бібліотека ім. В.І. Вернадського. URL: <http://www.nbu.gov.ua/>

Бібліотека ім. В.Г. Короленко. URL: <http://korolenko.kharkov.com/>

Бібліотека ХНТУСГ. URL: <https://library.khntusg.com.ua/>

Електронна бібліотека. URL: <http://lib.meta.ua/>

Студентська електронна бібліотека URL: <http://www.lib.ua-ru.net/>

Нормативно-правова база України URL: <http://zakon3.rada.gov.ua/>

Державна служба статистики України URL: <http://www.ukrstat.gov.ua/>