

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ

ХАРКІВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ МІСЬКОГО ГОСПОДАРСТВА  
імені О.М. БЕКЕТОВА

СТАНДАРТ ВИЩОЇ ОСВІТИ



**РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТ**

**ПРОГРАМА**

**вибіркової навчальної дисципліни**

**підготовки магістра**

**галузі знань 0306 Менеджмент і адміністрування**

**спеціальності 8.03060101 Менеджмент організацій і адміністрування  
(за видами економічної діяльності)**

**(шифр дисципліни за ОПП – МП 1)**

Стандарт чинний з дати затвердження

2014

Робоча програма з дисципліни «Ризик-менеджмент» для студентів за спеціальністю 8.03060101 Менеджмент організацій і адміністрування (за видами економічної діяльності)

Розробники: д.е.н., проф. Новікова М.М.

к.е.н., ст.викл. Діоба А.В.



Робочу програму схвалено на засіданні кафедри менеджменту і маркетингу в міському господарстві

Протокол від "29" серпня 2014 року № 1

Завідувач кафедри \_\_\_\_\_ (Новікова М.М.)

Робочу програму схвалено на засіданні випускової кафедри Менеджменту і маркетингу в міському господарстві

Протокол від "29" серпня 2014 року № 1

Завідувач випускової кафедри \_\_\_\_\_ (Новікова М.М.)

Програма відповідає формі Робочої програми навчальної дисципліни, що затверджена Наказом по ХНУМГ ім. О.М. Бекетова від 24 лютого 2014 р. №46-01.

Методист НМВ  
201 5 р.

Novikova M.M. Dioba A.V. ) "05" 05

(підпис)

(ПБ)

## ВСТУП

Програма вивчення навчальної дисципліни “Ризик-менеджмент” складена відповідно до освітньо-професійної програми підготовки магістрів зі спеціальності 8.03060101 “Менеджмент організацій і адміністрування (за видами економічної діяльності)”. Навчальним планом передбачена магістерська програма “Менеджмент організацій і адміністрування в міському господарстві”.

**Предметом** вивчення навчальної дисципліни є теоретичні та методичні основи процесів інвестиційної діяльності та аналізу її результативності.

### Міждисциплінарні зв'язки:

Вивчення цієї дисципліни безпосередньо спирається на:	На результати вивчення цієї дисципліни безпосередньо спираються:
Інвестиційний менеджмент	Дипломна робота
Фінансовий менеджмент	

Програма навчальної дисципліни складається з таких змістових модулів (ЗМ):

ЗМ 1. 1. Особливості ризик-менеджменту в макроекономіці

ЗМ 2. Ключові елементи ризик-менеджменту на мікрорівні  
Теоретично-методичні основи інвестиційного менеджменту

### 1. Мета та завдання навчальної дисципліни

1.1. Метою викладання навчальної дисципліни “Ризик-менеджмент” 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.

1.2. Основними завданнями вивчення дисципліни “Ризик-менеджмент” є формування у студентів:

- системи знань з теоретично-методичних основ розроблення та прийняття управлінських рішень;
- 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 оцінювання ефективності прийнятих управлінських рішень.

1.3. Згідно з вимогами освітньо-професійної програми студенти повинні:

#### **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.

#### ***мати компетентності:***

- розроблення, обґрунтування та прийняття управлінських рішень в трансформаційних умовах невизначеності та ризику та оцінювання їх ефективності;
- володіння практичними економіко-математичними методами щодо організації системи ризик-менеджменту на підприємстві.
- 

На вивчення навчальної дисципліни відводиться 144 години – 4,0 кредити ЄКТС.

## **2. Інформаційний обсяг навчальної дисципліни**

### **Змістовий модуль 1. Особливості ризик-менеджменту в макроекономіці**

Обов'язкові укрупнені навчальні елементи:

1. Поняття, сутність і роль ризиків в процесі управління
2. Сутність і зміст ризик-менеджменту. Організація ризик-менеджменту.
3. Стратегія та методи ефективного ризик-менеджменту як інструмента розвитку.
4. Національний рівень ризик-менеджменту: стабілізація та сприяння розвитку макроекономіці.
5. Роль міжнародного співтовариства в системі ризик-менеджменту

### **Змістовий модуль 2. Ключові елементи ризик-менеджменту на мікрорівні.**

6. Приватні особи та ризики, що їм загрожують: захищені домогосподарства та згуртовані громади.
7. Підприємницький сектор та безпечна фінансова система.
8. Інтегральний ризик-менеджмент: кількісні і якісні методи оцінки ризиків.
9. Регулювання та зниження ризиків.
10. Роль страхування в управлінні ризиками.

## **3. Рекомендована література**

1. Шегда А. В. Ризики в підприємстві: оцінювання та управління : навч. посіб. / А. В. Шегда, М. В. Головатенко. — К. : Знання, 2008. — 271 с.

2. Балабанов И. Т. Риск-менеджмент / И. Т. Балабанов. — М. : Финансы и статистика, 1996. — 192 с.
3. Балдин К. В., Воробьев В. С. Риск-менеджмент: Учеб. пос. / К. В. Балдин, В. С. Воробьев. – М.: Гардарика, 2005. – 285 с..
4. Кузьмін О.Є. Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків: навч. посібник / О.Є. Кузьмін, Г.Л. Вербницька, О.Г. Мельник.- Львів: Видавництво Національного університету «Львівська політехніка», 2008.- 212 с.
5. Лук'янова В.В. Економічний ризик: Навч. посібник / Лук'янова В.В., Головач Т.В. – К.: Академвидав, 2007. – 464 с.
6. Сахарцева І.І. Ризики економічної діагностики підприємства / І.І. Сахарцева, О.В. Шляга.- К.: Кондор, 2008.-380 с.
7. Управління підприємницьким ризиком / [за заг. ред. д.е.н. Д. А. Штефаніча]. — Тернопіль : «Економічна думка», 1999. — 224 с.

#### **4. Форма підсумкового контролю успішності навчання**

Підсумковий контроль з дисципліни здійснюється на основі письмового екзамену. Умовою допуску до екзамену є сума накопичення балів за двома змістовими модулями, яка повинна бути не менша, ніж 35 бали (за внутрішнім вузівським рейтингом або за системою ECTS). Екзамен здійснюється у письмовій формі за білетами. Білет складається з теоретичних питань та практичного завдання.

#### **5. Засоби діагностики успішності навчання**

Поточні та підсумкові тестові завдання, контрольні роботи, оцінювання виконання розрахунково-графічної роботи.

### **АНОТАЦІЯ**

#### **Ризик-менеджмент**

Метою викладання навчальної 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 вивчення навчальної дисципліни є теоретичні і методичні основи процесу прийняття управлінських рішень у професійній діяльності в умовах визначеності, невизначеності та ризику.

Змістові модулі: Особливості ризик-менеджменту в макроекономіці. Ключові елементи ризик-менеджменту на мікрорівні.

### **АННОТАЦИЯ**

#### **Риск-менеджмент**

Целью преподавания учебной дисциплины является формирование у студентов системы компетентностей, необходимых для обоснования управленческих решений с различной степенью неопределенности и риска в современных условиях трансформационных преобразований. Изучение теоретических и методических основ процесса принятия управленческих решений в профессиональной деятельности.

Предметом изучения учебной дисциплины являются теоретические и методические основы процесса принятия управленческих решений в профессиональной деятельности в условиях определенности, неопределенности и риска.

Содержательные модули: Особенности риск-менеджмента в макроэкономике. Ключевые элементы риск-менеджмента на микроуровне..

#### **ABSTRACT (ANNOTATION)**

##### **Risk Management**

The goal of teaching is to develop the system of student's competencies that are necessary to justify business decisions with varying degrees of uncertainty and risk in modern conditions of transformational change. The study of theoretical and methodological foundations of decision-making in professional activities.

The object of the course is the study of theoretical and methodological foundations of risk management decision making in professional activities under certainty, uncertainty and risk.

Content modules: Features risk management in macroeconomics. Key elements of risk management on the enterprises.