

Національний
транспортний
університет

ВБК 6 Ризик-менеджмент

Рівень вищої освіти – *другий (магістерський)*

Дні занять, час занять, аудиторія: будуть доступні згідно розкладу за посиланням <http://www.ntu.edu.ua/studentam/rozklad/>

Кафедра менеджменту

Лекції проводить

к.е.н., доц. Ільченко Вікторія Юліанівна

Контактна інформація v.ilchenko@ntu.edu.ua
+380442808438

Адреса, номер аудиторії вул. Михайла Омеляновича-Павленка 1, ауд.241

Час консультацій Чт. з 14-30 до 16-00

Практичні заняття проводить

к.е.н., доц. Ільченко Вікторія Юліанівна

Контактна інформація v.ilchenko@ntu.edu.ua
+380442808438

Адреса, номер аудиторії вул. Михайла Омеляновича-Павленка 1, ауд.241

Час консультацій Чт. з 14.30 до 16-00

Анотація курсу: формування у студентів фахових компетентностей, теоретичних знань з основ ризик-менеджменту, оволодіння практикою застосування методів кількісної оцінки ризику в умовах ринкових відносин та прийняття ефективних управлінських рішень в ситуаціях невизначеності та ризику.

Предметом вивчення є принципи, методи та форми управління ризиками підприємства.

Міждисциплінарні зв'язки: викладення матеріалу пов'язане з вивченням наступних освітніх компонентів: менеджмент організацій та управління змінами, управління якістю, корпоративне управління, сучасні проблеми теорії і практики в управлінні, фінансовий менеджмент.

Програма навчальної дисципліни складається з таких модулів:

Модуль 1 Сутність ризик-менеджменту на підприємстві

Тема 1 Ризик і підприємництво

Сутність ризик-менеджменту. Визначення та джерела виникнення ризику. Зовнішні та внутрішні чинники ризику. Загальна класифікація ризику. Характеристика видів ризиків. Чисті та спекулятивні ризики.

Тема 2 Процес управління ризиками на підприємстві

Система управління ризиками. Якісний та кількісний аналіз ризику. Відбір ризиків. Ранжування ризиків.

Тема 3 Показники ризику та ймовірнісний (статистичний) метод оцінки ризику

Загальні підходи щодо кількісної оцінки ступеня ризику. Зони ризику. Ймовірнісний (статистичний) метод оцінки ризику. Ризик в абсолютному та відносному вираженні.

Тема 4 Збитки фірми та методи управління ризиками

Збитки фірми та їх класифікація. Система методів впливу на ризик. Прийоми зниження ступеня ризику. Фінансування ризику.

Модуль 2 Функціональний ризик-менеджмент

Тема 5 Ризик-менеджмент у сфері фінансів

Фінансові ризики: суть і класифікація. Методичний інструментарій оцінки рівня фінансового ризику. Методи управління фінансовими ризиками.

Тема 6 Ризик-менеджмент у зовнішньоекономічній діяльності

Зовнішньоекономічні ризики та їх види. Специфіка управління зовнішньоекономічними ризиками.

Тема 7 Управління ризиками в маркетингу

Ризики виходу на внутрішній ринок. Ризики виходу на міжнародний ринок. Національні особливості ведення маркетингової діяльності. Механізм подолання основних видів маркетингових ризиків.

Тема 8 Транспортний ризик та методи його зниження

Основні види транспортних ризиків. Способи управління ризиками у транспортній сфері. Мінімізація збитків при транспортуванні застрахованих вантажів.

Методи контролю: Методи поточного контролю: поточне тестування, індивідуальне опитування, фронтальне опитування, перевірка домашніх завдань, перевірка індивідуальних завдань.

Методи модульного контролю: письмова контрольна робота, підсумкове тестування.

Джерела для вивчення курсу –

1. Електронний ресурс бібліотеки НТУ: <http://lib.ntu.edu.ua/catalog/login.html>
2. Віртуальне середовище навчання (Google classroom).
3. Доступ до матеріалів щодо анотації лекцій, тематики та методичних вказівок до практичних робіт, самостійної роботи, питань до модульних контрольних робіт, підсумкового контролю тощо можна отримати за посиланням: <https://drive.google.com/drive/folders/1YkFU1XRMll0qSJrAJC9bOsabSXuaXb70?usp=sharing>

Оцінювання

Підсумкова оцінка вивчення курсу розраховується з використанням наступних категорій

Поточне, підсумкове тестування та самостійна робота (максимальна кількість балів)										Залік	Підсумковий контроль (максимальна кількість балів разом)
Модуль 1					Модуль 2						
Відвідування	Активність	Виконання СРС	Поточний контроль	Модульний контроль	Відвідування	Активність	Виконання СРС	Поточний контроль	Модульний контроль		
Семестр II											
4	9	5	5	7	6	7	6	4	7	40	100

Критерії оцінювання http://vstup.ntu.edu.ua/pro_orhanizatsiyu_osvitnoho_protseesu.pdf.

Політика несвоєчасної здачі роботи. поточні та підсумкові контролі проводяться відповідно до встановлених деканатом графіків. У випадку неявки здобувача вищої освіти на контроль за поважних причин є можливість індивідуального проведення в узгоджений з викладачем термін за наявності дозволу деканату.

Повторне складання екзамену у випадку отримання незадовільної оцінки допускається не більше двох разів: один раз – викладачу, другий – комісії, яка створюється деканом факультету.

Запізнені завдання. При здачі роботи без поважної причини пізніше встановленого терміну оцінка буде знижена на 10 %. Технічні проблеми (поломка обладнання, проблеми з друком) не є поважною причиною для несвоєчасної здачі роботи.

Політика переоцінки. Упродовж тижня після оголошення результатів поточного контролю здобувач освіти може звернутися до оцінювача за роз'ясненням і/або з незгодою щодо отриманої оцінки. У випадку незгоди з рішенням оцінювача щодо результатів семестрового контролю здобувач освіти може звернутися до оцінювача з незгодою щодо отриманої оцінки у день її оголошення. Перескладання семестрового контролю з метою підвищення позитивної оцінки не допускається.

Політика відвідування та / або активності. Відвідування навчальних занять є обов'язковим для здобувача освіти. Вільне відвідування лекційних занять можливе лише за дозволом декана факультету. Невиконання здобувачем освіти завдань, що визначені індивідуальним навчальним планом практичних, семінарських і лабораторних занять, через відсутність на заняттях є підставою для прийняття рішення про недопущення до семестрового контролю. За рішенням декана факультету буде надана можливість виконати пропущені завдання за індивідуальним графіком (але не пізніше, ніж до завершення семестрового контролю).

Плагіат, академічна доброчесність http://vstup.ntu.edu.ua/polozhennyantu_dobroch.pdf.

Порушенням академічної доброчесності є:

- академічний плагіат;
- фальсифікація;
- списування;
- обман;
- хабарництво.

При проходженні контролю (поточного або підсумкового) особа, яка проходить контроль, не має права використовувати будь яку зовнішню (сторонню) допомогу. Якщо оцінювач підозрює особу, що проходить контроль, у використанні недозволених допоміжних засобів, він має право запропонувати їй учинити дії, які б спростували підозру. У разі відмови, списування, використання недозволених допоміжних засобів чи зовнішньої допомоги (обману) результат оцінюється як «0» балів («незадовільно»).

Поведінка в аудиторії. Ноутбуки та портативні пристрої можна використовувати **ВИКЛЮЧНО** з навчальною метою за вказівкою викладача. Неправильне використання ноутбуків чи кишенькових пристроїв вважатиметься порушенням дисципліни, викладач має право ініціювати відповідні дії. В аудиторії забороняється вживання їжі, напоїв (за винятком води). Студенти та викладачі повинні дотримуватися етичних норм поведінки.

Для студентів з обмеженими можливостями або особливими потребами слід звернутися до деканату та обговорити з викладачем питання організації навчання якомога раніше.

При виникненні у студента проблем зі здоров'ям, які можуть заважати навчанню (напружені стосунки, посилене занепокоєння, вживання заборонених речовин, почуття слабкості, труднощі з концентрацією уваги та/або відсутність мотивації) слід звернутися до медичного пункту, що розташований в будівлі гуртожитку №3 за адресою вул. Бойчука, 36.

Свої скарги, пропозиції, зауваження та повідомлення про наявність конфліктних ситуацій в рамках освітніх програм здобувачі можуть надсилати електронною поштою за адресою: general@ntu.edu.ua, або скористатися скринькою довіри, яка розміщена при вході в університет. E-mail звернень до психологічної служби: philosophy@ntu.edu.ua.

Зв'язок з викладачем: e-mail: v.ilchenko@ntu.edu.ua тел.:+380442808438

Рекомендована література:

Основна:

1. Гуменник В.І. Менеджмент організацій : навч. посіб. / В.І. Гуменник, Ю.С. Копчак, О.С. Кондур. – К. : Знання, 2012. – 503 с.
2. Вітлінський В.В., Верченко П.І. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком : Навч. - метод. посібник для самост. вивч. дисц. – К. : КНЕУ, 2000. – 292 с.
3. Вітлінський В.В., Наконечний С.І., Шарапов О.Д. Економічний ризик та методи його вимірювання : Підруч. – К. : КНЕУ, 2000. – 354 с.
4. Вовчак О.Д. Страхування : навч. посібник / О.Д. Вовчак. – Львів : Новий Світ, 2005. – 480 с.
5. Івченко І.Ю. Економічні ризики: Навчальний посібник. – К. : ЦНЛ, 2004. – 304 с.
6. Камінський А. Б. Економічний ризик та методи його вимірювання : Навч. посіб. – К. : Вид. дім «Козаки», 2002. – 120 с.
7. Лещинський О. Л., Школьний О. В. Економічний ризик та методи його вимірювання : Навч. посіб. для студентів вищих навчальних закладів. Київ, «Дельта», 2005. – 112 с.
8. Машина Н.І. Економічний ризик і методи його вимірювання : Навчальний посібник. – К. : ЦНЛ, 2003. – 188 с.
9. Обґрунтування господарських рішень та оцінка ризиків : навч. посібник / М.Д. Балджи, В.А. Карпов, А.І. Ковальов та ін. – Одеса : ОНЕУ, 2013. – 670 с.
10. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання ризиків : навч. посібник / Л.І. Донець, О.В. Шепеленко, С.М. Баранцева, та ін. ; за заг. ред. Л.І. Донець. – К. : Центр навч. л-ри, 2012. – 472 с.
11. Писаревський І.М., О.Д. Стешенко. Управління ризиками : навч. посібник. – Харків : ХНАМГ, 2008. – 124 с.
12. Старостіна А. О., Кравченко В. А. Ризик-менеджмент: теорія та практика : Навч. посіб. – К. : ІВЦ “Видавництво «Політехніка»”, 2004. – 200 с.
13. Старостіна А. О., Кравченко В. А. Ризик-менеджмент у маркетингу // <http://www.4p.com.ua/som/9.html>
14. Сулим М. В., Пенцак О. В. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання ризиків : Підручник для студентів вищих навчальних закладів. – Львів : «Новий Світ – 2000», 2011. – 330 с.
15. Barton Thomas L., Shenkir William G, Walker Paul L. Making enterprise risk management pay off, 2003. – 208 р. URL: file:///C:/Users/%D0%9F%D0%BE%D0%BB%D1%8C%D0%B7%D0%BE%D0%B2%D0%B0%D1%82%D0%B5%D0%BB%D1%8C/Downloads/%D0%9A%D0%BE%D0%BC%D0%BF%D0%BB%D0%B5%D0%BA%D1%81%D0%BD%D1%8B%D0%B9_%D0%BF%D0%BE%D0%B4%D1%85%D0%BE%D0%B4_%D0%BA_%D1%80%D0%B8%D1%81%D0%BA_%D0%BC%D0%B5%D0%BD%D0%B5%D0%B4%D0%B6%D0%BC%D0%B5%D0%BD%D1%82%D1%83_%D1%81%D1%82%D0%BE%D0%B8%D1%82_%D0%BB%D0%B8_%D1%8D%D1%82%D0%B8%D0%BC_%D0%B7%D0%B0%D0%BD%D0%B8%D0%BC%D0%B0%D1%82%D1%8C%D1%81%D1%8F.pdf
16. Van Home James C, Wachowicz John M. Fundamentals of Financial Management, 2008. - 1232 p. URL: [Основы финансового менеджмента Ван Хорн, Вахович 2008 -1232c.pdf](http://www.4p.com.ua/som/9.html)

17. Ilchenko V., Bondarenko V., Koroliova O., Petrovska S., Kumar R. Effect of Emerging Technology on Enhancing the Environmental Condition of Urban Areas: A Case of Ukraine. *International Journal of Advanced Science and Technology*. 2020. Vol. 29, No. 6s. P. 1101-1108. URL: <http://sersc.org/journals/index.php/IJAST/article/view/9197>. **Scopus**
18. Ilchenko V., Bondarenko V., Zhelezniak K., Petrovska S., Reznik N. Assessment of the Competitiveness of Travel Agencies in Ukraine: Methodological Tools. *The Importance of New Technologies and Entrepreneurship in Business Development: In The Context of Economic Diversity in Developing Countries. ICBT 2020. Lecture Notes in Networks and Systems Lecture Notes in Networks and Systems*. 2021. Vol. 194. P. 742–753. URL: https://doi.org/10.1007/978-3-030-69221-6_56 **Scopus**
19. Компанець К.А., Ільченко В.Ю., Ложачевська О.М. Ризиковий бар'єр в галузі міжнародного бізнесу. *Економіка та суспільство*. 2021. № 31. URL: <https://economyandsociety.in.ua/index.php/journal/article/view/734/706> DOI: <https://doi.org/10.32782/2524-0072/2021-31-51>
20. Компанець К.А., Ільченко В.Ю., Хобта М.О. Застосування системного аналізу в дослідженні ризиків природоохоронної діяльності автотранспортних підприємств. *Наукові інновації та передові технології*. 2022. №2. С. 174-187 DOI: [https://doi.org/10.52058/2786-5274-2022-2\(4\)-174-187](https://doi.org/10.52058/2786-5274-2022-2(4)-174-187). URL: <http://perspectives.pp.ua/index.php/nauka/article/view/1048/1047>
21. Хобта М.О., Ільченко В.Ю., Сукманюк В.М. Застосування статистичних методів в управлінні зовнішньоекономічної діяльності транспортної компанії. *Приазовський економічний вісник*. 2021. № 6 (29). С. 23-28. DOI: <https://doi.org/10.32840/2522-4263/2021-6-4>. URL: http://pev.kpu.zp.ua/journals/2021/6_29_ukr/6.pdf
22. Ільченко В.Ю., Кобець С.П., Джегур Г.В., Бондар В.Ю. Оцінка та прогнозування ефективності управління інноваційним потенціалом підприємства в умовах активізації ЗЕД, глобалізації, міграційної кризи та фінансово-економічних ризиків. *Формування ринкових відносин в Україні*. 2022. №2 (249). С. 48-54. URL: <http://dndiime.org/wp-content/uploads/2022/06/2-2022.pdf>
23. Компанець К.А., Ільченко В.Ю., Хобта М.О. Застосування системного аналізу в дослідженні ризиків природоохоронної діяльності автотранспортних підприємств. *Наукові інновації та передові технології*. 2022. №2. С. 174-187 DOI: [https://doi.org/10.52058/2786-5274-2022-2\(4\)-174-187](https://doi.org/10.52058/2786-5274-2022-2(4)-174-187). URL: <http://perspectives.pp.ua/index.php/nauka/article/view/1048/1047>
24. Смагін В.Л., Ільченко В.Ю., Малахова Ю.А., Заплітна Т.В. Дослідження інституціональних закономірностей розвитку фінансового ринку в нерівноважних економічних системах. *Вісник Національного транспортного університету. Серія «Економічні науки». Науково-технічний збірник*. 2022. Вип. 2 (52). С. 257-268. DOI: 10.33744/2308-6645-2022-2-52-257-268. URL: <http://publications.ntu.edu.ua/visnyk/52/UKR.htm>
25. Levkovets N., Ilchenko V., Boiko S., Masalitina V., Tesliuk N. Risk-Oriented Approach to Financial Security of Motor Transport Enterprises. *Explore Business, Technology Opportunities and Challenges After the Covid-19 Pandemic. ICBT 2022. Lecture Notes in Networks and Systems*. 2023. Vol 495. P. 1078-1094. https://doi.org/10.1007/978-3-031-08954-1_91 URL: <https://link.springer.com/book/10.1007/978-3-031-08954-1?page=5&oscar-books=true#toc> **Scopus**
- Електронні ресурси:**
26. Офіційний сайт Державної служби статистики України. Режим доступу: <http://ukrstat.gov.ua/>
27. Офіційний сайт Національного інституту стратегічних досліджень. Режим доступу: <http://www.niss.gov.ua>
28. Офіційний сайт Українського центру економічних і політичних досліджень ім. О.Разумкова. Режим доступу: <http://www.uceps.org>
29. Офіційний сайт Інституту економіки природокористування та сталого розвитку Національної академії наук України. Режим доступу: <http://www.ecos.kiev.ua>
30. Офіційний сайт Інституту глобальних стратегій. Режим доступу: <http://www.igls.com.ua> –
31. База українського законодавства в Інтернет. Режим доступу: <http://www.lawukraine.com>

32. Офіційний сайт EERC – консорціум економічних досліджень. Режим доступу:
<http://www.eurasia.org/eerc/kyev/>
33. Офіційний сайт Національної бібліотеки України ім. В.І. Вернадського. Режим доступу:
<http://www.nbu.gov.ua>.
34. Офіційний сайт Національної парламентської бібліотеки. Режим доступу:
<http://www.alpha.rada.kyev.ua>.
35. Офіційний сайт Наукової бібліотеки ім. Максимовича. Режим доступу:
<http://www.lib-gw.univ.kyev.ua>