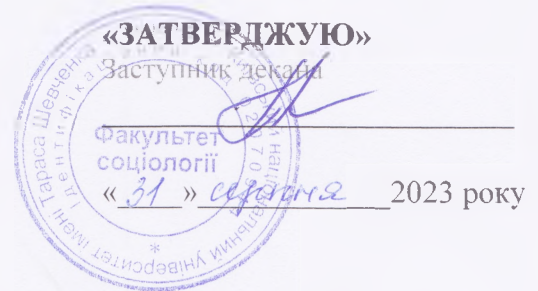


КИЇВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ІМЕНІ ТАРАСА ШЕВЧЕНКА

Факультет соціології



РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ
Ризик-менеджмент в бізнесі

для студентів

галузь знань 05 Соціальні та поведінкові науки

спеціальність 054 «Соціологія»

освітній рівень бакалавр

освітня програма «Соціологічне забезпечення управлінських процесів»

вид дисципліни вибіркова

Форма навчання	денна
Навчальний рік	2023/2024
Семестр	8
Кількість кредитів ECTS	4
Мова викладання, навчання та оцінювання	українська
Форма заключного контролю	залік

Викладачі: Василь ЕРАСТОВ

Пролонговано: на 20__/20__ н.р. _____ (_____) «__» __ 20__ р.
(підпис, ПІБ, дата)
на 20__/20__ н.р. _____ (_____) «__» __ 20__ р.
(підпис, ПІБ, дата)

КИЇВ – 2023

Розробник: Василь ЕРАСТОВ, к.е.н., асистент кафедри страхування, банківської справи та ризик-менеджменту

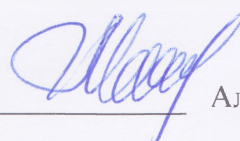
ЗАТВЕРДЖЕНО

Зав. кафедри страхування, банківської справи та ризик-менеджменту

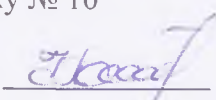
 Наталія ПРИКАЗЮК

Протокол № 1 від «31» серпня 2023 р.

Схвалено науково-методичною комісією економічного факультету

Протокол від «31» серпня 2023 року № 1
Голова науково-методичної комісії  Аліна МАГОМЕДОВА

Погоджено з науково-методичною комісією факультету соціології

Протокол від «31» серпня 2023 року № 10
Голова науково-методичної комісії  Тетяна ЧЕРВІНСЬКА

1. Мета дисципліни - формування знань у сфері ризик-менеджменту в бізнесі, як для фінансових, так і нефінансових корпорацій.

2. Попередні вимоги до опанування або вибору навчальної дисципліни:

1. Успішне опанування курсів «Основи економіки та підприємництва», «Основи соціального менеджменту», «Оцінювання соціальних проектів та програм»
2. Вміння застосовувати методи аналізу кількісних соціологічних даних

3. Анотація навчальної дисципліни:

Будь-які ризики прямо чи опосередковано є фінансовими ризиками, що вимагає необхідних знань і вмінь щодо управління ними. Вказане визначає місце вибіркової дисципліни «Ризик-менеджмент в бізнесі» серед предметів ОП «Соціологічне забезпечення управлінських процесів».

4. Завдання (навчальні цілі) - формування знань у сфері фінансового ризик-менеджменту для отримання таких компетентностей: **Інтегральна компетентність (ІК)** Здатність розв'язувати складні спеціалізовані задачі та практичні проблеми у сфері соціології, що передбачають застосування основних соціологічних теорій і методів та характеризуються комплексністю та невизначеністю умов. **Спеціальні компетентності:** СК09. Здатність прогнозувати розвиток соціальних процесів в організаціях, галузях та регіонах СК13. Здатність прогнозувати тенденції розвитку структур менеджменту і маркетингу в умовах суспільних змін та глобальних трансформацій СК14. Здатність визначати соціальні механізми стабільного функціонування та розвитку організаційних систем

5. Результати навчання за дисципліною:

Код	Результат навчання	Форми (та/або методи і технології) викладання і навчання	Методи оцінювання та порогів критерій оцінювання	Відсоток у підсумковій оцінці з дисципліни
1.1	Основні поняття фінансового-ризик-менеджменту	Лекції	Тести, опитування	10
2.1	Кількісно визначати величину ризику	Практичне заняття	Тести, опитування, розв'язування задач	15
2.2	Розраховувати економіко-політичний ризик	Практичне заняття	Тести, опитування, розв'язування задач	15
2.3	Визначати розмір страхового тарифу та запас платоспроможності страховика	Практичне заняття	Тести, опитування, розв'язування задач	10
2.4	Розраховувати портфельний ризик	Практичне заняття	Тести, опитування, розв'язування задач	10
2.5	Оцінювати ризик неплатоспроможності суб'єкта господарювання	Практичне заняття	Тести, опитування, розв'язування задач	10
2.6	Розраховувати кредитний і процентний ризику	Практичне заняття	Тести, опитування, розв'язування задач	10
3.1	Здатність презентувати результати роботи (зрозуміле і недвозначне донесення власних висновків, а також знань та пояснень, що їх обґрунтовують, до фахівців, зокрема до осіб, які	Практичне заняття, самостійна робота	Захист звітів із самостійної роботи	10
4.1	Здатність самостійно вирішувати завдання, збирати, опрацьовувати, узагальнювати інформацію та відповідати за результати своєї діяльності	Практичне заняття, самостійна робота	Контрольні роботи	10

6. Співвідношення результатів навчання дисципліни із програмними результатами навчання

Результати навчання дисципліни (код) Програмні результати навчання (назва)	1.1	2.1	2.2	2.3	2.4	2.5	2.6	3.1	4.1
Прогнозувати тенденції розвитку організаційних структур в умовах суспільних змін та глобальних трансформацій (ПРН13)	+				+	+	+	+	
Здійснювати аналіз проблем соціальної організації із застосуванням системи соціологічного знання (ПРН16)		+	+	+					+

7. Схема формування оцінки.

7.1 Форми оцінювання студентів:

- семестрове оцінювання:

1. Тестування (РН 1.1) (мін: **12 балів**; мах: **20 балів**)
2. Опитування (РН 1.1, РН 2.1-2.6) (мін: **12 балів**; мах: **20 балів**)
3. Розв'язування практичних задач (РН 2.1) (мін: $8 \cdot 2 = 16$ балів; мах: $8 \cdot 3 = 24$ балів)
4. Контрольні роботи (РН 3.1, РН 4.1) (мін: $2 \cdot 6 = 12$ балів; мах: $2 \cdot 10 = 20$ балів)
5. Захист звітів з самостійної роботи студента (РН 3.1, РН 4.1) (мін: $1 \cdot 8 = 8$ балів; мах: $1 \cdot 12 = 16$ балів)

балів)

- підсумкове оцінювання у формі заліку. Залік виставляється за результатами роботи протягом семестру.

7.2 Організація оцінювання:

1. Опитування відбувається на практичних заняттях та оцінюються за фактом їх реального проведення, а бали накопичуються протягом усього семестру шляхом усних відповідей.
2. Тестування відбувається на практичних заняттях та оцінюються за кількістю правильних відповідей
3. Розв'язання практичних задач відбувається на практичних заняттях та оцінюються шляхом обговорення зі студентами та викладачем
4. Контрольна робота 1 спрямована на перевірку теоретичних знань, засвоєних студентами, виконується студентами в межах аудиторного заняття після вивчення тем 1-4
5. Контрольна робота 2 спрямована на перевірку опанування конкретними вміннями з розв'язання практичних задач, виконується у межах аудиторного заняття після вивчення тем 5-12.
6. Захист звітів з самостійної роботи відбувається на практичних заняттях шляхом усних відповідей студентів.

7.3 Шкала відповідності оцінок

Зараховано / Pass	60-100
Не зараховано / Fail	0-59

8. Структура навчальної дисципліни. Тематичний план лекцій та практичних занять

№ п/п	Назва теми	Кількість годин		
		Лекції	Практичні	Самостійна робота
«Основи фінансового ризик-менеджменту»				
1	Сутність фінансових ризиків та їх класифікація	2	4	5
2	Основи ризик-менеджменту та кількісні оцінки фінансових ризиків	2	2	5
3	Фінансовий ризик-менеджмент у страховій компанії	2	2	5
4	Політико-економічний ризик у системі ризик-менеджменту	2	4	5
	Контрольна робота 1	2		
«Специфіка управління фінансовими ризиками»				
5	Управління інвестиційними ризиками. Управління ризиком портфелю фінансових інструментів	4	4	5
6	Управління ризиком неплатоспроможності суб'єкта господарювання	4	4	5
7	Управління кредитним ризиком	2	4	5
8	Управління процентним ризиком	2	2	5
9	Управління фінансовим ризиком на іпотечному	2	2	6
10	Управління ризиком ліквідності		2	6
11	Управління валютним ризиком		2	4
12	Управління фінансовими ризиками у банку		2	4
	Контрольна робота 2	2		
	Всього	26	34	60

Загальний обсяг 120 год., в тому числі:

Лекцій – 26 год.

Практичні заняття - 34 год.

Самостійна робота - 60 год.

9. Рекомендовані джерела:

Основна:

1. Міждисциплінарний словник зі страхування та ризик-менеджменту / [Р.В. Пікус, Н.В. Приказюк та ін.]; за наук. ред. проф. Р.В. Пікус. Київ: Логос, 2015. 509 с.
2. Пікус Р.В. Управління фінансовими ризиками: навчальний посібник / Пікус Р.В., 2-ге вид., виправл. - К.: Знання, 2011. - 598 с.
3. Пікус Р.В. Управління фінансовими ризиками: Опорний конспект лекцій / Пікус Р.В., Приказюк Н.В. - Кам'янець-Подільський: Аксіома, 2010. - 228 с.
4. Ринок фінансових послуг: підручник / кол. авторів; за ред. Н.В. Приказюк. К.: Компрінг, 2019. 757 с.
5. Управління фінансовими ризиками: лабораторний практикум. / Р.В. Пікус, Н.В. Приказюк, Г.Ю. Тлуста, Г.І. Олійник. - К.: Логос, 2018. - 213 с.
6. Шолойко А.С. Забезпечення стійкості страхового ринку України / Шолойко А.С. // Вісник Академії праці, соціальних відносин і туризму. - 2018. - № 4. - С. 31-41.
7. Шолойко А.С. Роль оцінки ризиків при прийнятті рішень суб'єктами господарювання / А.С. Шолойко // Збірник «Теоретичні та прикладні питання економіки». - 2015. - № 1 (30). - С. 416-422.

Додаткова:

1. Бігар Н.М. Діяльність банківських та небанківських фінансових установ в Україні. Науковий вісник Ужгородського університету. Серія: Економіка. 2019. № 1 (53). С. 141-145.
2. Версаль Н. І. Фінансові шоки в банківській системі України: теорія, практика та шляхи адаптації: монографія. Київ: ФОП Ямчинський О.В., 2019. 470 с.

3. Закон України «Про банки і банківську діяльність»/ URL: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/2121-14#Text>
4. Закон України «Про інститути спільного інвестування» 5 липня 2012 р. № 5080-VI. URL: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/5080-17>
5. Закон України «Про іпотеку» №898-IV від 5 червня 2003 р. URL: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/1734-19#Text>
6. Закон України «Про кредитні спілки» № 2908-III від 20 грудня 2001 р. URL: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/2908-14>
7. Закон України «Про страхування». URL: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/85/96-%D0%B2%D1%80>
8. Пікус Р.В. Взаємодія страхових компаній і банків на ринку фінансових послуг України : [монографія] / Пікус Р.В., Олійник Г.І. - К. : Компринт, 2015. - 186 с.
9. Пікус Р.В. Страхування ризиків іпотечного кредитування в Україні : [монографія] / Пікус Р.В., Тлуста Г.Ю. - К. : Логос, 2012. - 191 с.
10. Ризикогенність та страхування в аграрній сфері (теорія, практика) : колективна монографія / [Віленчук О.М., Литвинчук І.Л., Януль І.Є. та ін.] ; за ред. д.е.н., проф. Ходаківського Є.І. - Житомир : Полісся, 2013. - 323 с.
11. Страхування: Підручник / За ред. В.Д. Базилевича. - К.: Знання, 2008. - 1019 с
12. Шолойко А.С. Корпоративний ризик-менеджмент компаній реального сектору / А.С. Шолойко // Modern Transformation of Economics and Management in the Era of Globalization: International scientific conference proceedings, January 29, 2016. Klaipeda: Baltija Publishing. - P. 319-322.
13. Шолойко А.С. Стандарти ризик-менеджменту для компаній реального сектору / А.С. Шолойко // Економічний розвиток і спадщина Семена Кузнеця: матеріали Міжнародної наукової конференції, 26-28 травня 2016 р. - Х.: ХНЕУ (електронний додаток до матеріалів Міжнародної наукової конференції), 2016. - С. 227 - 230.
14. Jimmy Skoglund, Wei Chen. Financial Risk Management: Applications in Market, Credit, Asset and Liability Management and Firmwide Risk// John Wiley & Sons, 2015. - 576p.
15. Leika Kihara BOJ warns Japan's bank risk-taking hits near 30-year high. Reuters. Business News, October, 2018. URL: <https://www.reuters.com/article/us-japan-economy-boj-banking/idUSKCN1MW0KX>.
16. Satyendra K.S. The process of decision making URL: <http://ispatguru.com/the-process-of-decision-making/>.