

## РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТ

Кафедра менеджменту  
Факультет менеджменту

### **Анотація:**

**Мета курсу (інтегральна компетентність)** – формування у майбутніх магістрів сучасного рівня знань щодо методології управління ризиком та оволодіння практичним інструментарієм застосування прийомів і методів зниження ризику та створювання умов безпеки в фінансово-господарській діяльності суб'єкту господарювання.

### **Цілі курсу (програмні компетентності):**

- визначати, розраховувати й аналізувати ризики, що притаманні фінансово-економічній та виробничого господарській діяльності підприємства;
- вимірювати розмір сподіваних доходів та ризику в комерційних заходах організації;
- визначати ефективність інвестиційних проектів з урахуванням чинників ризику;
- ідентифікувати та аналізувати можливий вплив факторів ризику та виявляти симптоми кризових ситуацій;
- забезпечувати безпеку та ризикозахищеність діяльності підприємства;
- приймати стратегічні рішення з урахуванням концепції корисності та ризику;
- обирати оптимальну стратегію розвитку підприємства з урахуванням прийнятного рівня ризику.

### **Програмні результати навчання:**

- критично осмислювати, вибирати та використовувати необхідний науковий, методичний і аналітичний інструментарій для управління в непередбачуваних умовах;
- ідентифікувати проблеми в організації та обґрунтовувати методи їх вирішення;
- проектувати ефективні системи управління організаціями;
- обґрунтовувати та управляти проектами, генерувати підприємницькі ідеї.

### **Короткий зміст курсу:**

Ризик у менеджменті та основні принципи його аналізу. Сутність та системні характеристики менеджменту. Загальні проблеми, головні цілі менеджменту та ризик. Аналіз ризику. Основні причини виникнення ризику. Класифікація ризику та основні підходи управління ним. Структура ризику та типи поведіння менеджерів (суб'єктів ризику). Підприємницький ризик. Сутність підприємницького ризику. Причини виникнення підприємницького ризику. Функції підприємницького ризику. Ризики у виробничому підприємстві. Ризики відсутності попиту на вироблену продукцію. Ризики невиконання господарських договорів (контрактів). Ризики підсилення конкуренції. Ризики виникнення непередбачених витрат та зниження доходів. Ризики втрати майна суб'єктом підприємництва. Фінансовий ризик. Ризики у фінансовому менеджменті. Трансляційний валютний ризик. Роль форвардних операцій в

управлінні валютними ризиками. Роль валютних фьючерсів в управлінні валютними ризиками. Хеджування, як засіб управління ризиком. Короткострокові відсоткові фьючерси, їх роль в управлінні ризиками. Довгострокові відсоткові фьючерси, їх роль в управлінні ризиками. Використання валютних опціонів в управлінні ризиками. Біржові валютні опціони в управлінні ризиками. Відсоткові опціони в управлінні ризиками. Валютні свопи в управлінні ризиками. Відсоткові свопи в управлінні ризиками. Інвестиційні ризики. Обґрунтування стратегії ризик-менеджменту суб'єкту господарювання. Загальні засади стратегічного управління суб'єктом господарювання з врахуванням ризику. Формування інвестиційної стратегії суб'єкта господарювання. Аналіз підгалузей національної економіки щодо інвестицій. Аналіз регіонів щодо інвестицій. Оцінка інвестиційної стратегії компанії. Принципи формування інвестиційного портфеля з урахуванням ризику.