

СИЛАБУС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ «УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ ПІДПРИЄМСТВА»

Лектор курсу			Сукурова Наталя Михайлівна, кандидат економічних наук, доцент кафедри економіки підприємств та соціальних технологій		Контактна інформація лектора (e-mail), сторінка курсу в Moodle		e-mail: epst_2017@ukr.net ; сторінка курсу в Moodle – http://dl.dut.edu.ua/course/view.php?id=1199	
Галузь знань			05 Соціальні та поведінкові науки		Рівень вищої освіти		магістр	
Спеціальність			051 Економіка		Семестр		10	
Освітня програма			2441 «Професіонал у галузі економіки»		Тип дисципліни		Вибіркова	
Обсяг:	Кредитів ECTS	Годин	За видами занять:					
			Лекцій	Семінарських занять	Практичних занять	Лабораторних занять	Самостійна підготовка	
	5	150	24	-	24	-	102	

АНОТАЦІЯ КУРСУ

Мета курсу:	формування у студентів системи знань, умінь і навичок щодо системного аналізу категорії економічного ризику, що виникає в ринкових умовах господарювання, на основі використання засобів та інструментів вербального аналізу, якісних підходів, економіко-математичних методів та моделей.
-------------	--

Компетентності відповідно до освітньої програми

Soft- skills / Загальні компетентності (ЗК)	Hard-skills / Спеціальні компетентності (ПП)
	ПП8. Здатність формувати систему управління ризиками підприємства з метою упередження кризових станів в умовах розвитку цифрової економіки ПП11. Здатність застосовувати сучасні Інтернет-технології для аналізу, планування та прогнозування фінансово-економічної діяльності підприємств

Програмні результати навчання (ПРН)

ПРН11 Використовувати методи управління ризиками результати з метою вдосконалення економічної діяльності ринкового суб'єкта .
--

ОРГАНІЗАЦІЯ НАВЧАННЯ

Тема, опис теми	Вид заняття	Оцінювання за тему	Форми і методи навчання/питання до самостійної роботи
Розділ 1 «Концептуальні основи ризикології в підприємстві»			
Тема 1. <i>Ризик як економічна категорія.</i> Знати: поняття ризику, функції та джерела ризику, аксіоматика ризикології, особливості ризику в сучасних умовах господарювання. Вміти: орієнтуватися категоріальним апаратом ризикології в	Лекція 1	5,5*	Лекція-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 1		Усне опитування, навчальна дискусія, обговорення ситуаційного завдання
	Лекція 2		Лекція-візуалізація, експрес-опитування студентів

<p>підприємстві.</p> <p>Формування компетенцій: ПП8, ПП11</p> <p>Результати навчання: ПРН11</p>	Практичне заняття 2		Усне опитування, навчальна дискусія, доповідь з презентацією за тематикою самостійного вивчення дисципліни
			Тестування, навчальна дискусія, вирішення задач
<p>Тема 2. Невизначеність та ризик.</p> <p>Знати: сутність понять «невизначеність» та «ймовірність», причини невизначеності та їх ієрархія, види втрат в умовах невизначеності й ризику.</p> <p>Вміти: орієнтуватися в практичній діяльності в поняттях «невизначеність» та «ймовірність», визначати причини невизначеності.</p> <p>Формування компетенцій: ПП8, ПП11</p> <p>Результати навчання: ПРН11</p> <p>Рекомендовані джерела: 1, 3–8</p>	Лекція 3	5,5*	Лекція-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 3		Тестування, навчальна дискусія, обговорення ситуаційного завдання
	Лекція 4		Лекція-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 4		Усне опитування, навчальна дискусія, доповідь з презентацією за тематикою самостійного вивчення дисципліни
			Проведення модульного контролю № 1 «Концептуальні основи ризикології в підприємстві»
<p>Тема 1. Ризик як економічна категорія</p> <p>Тема 2. Невизначеність та ризик</p>	Самостійна робота		<ol style="list-style-type: none"> 1. Сутність, причини виникнення та фактори, що впливають на виникнення ризику 2. Причино-наслідкові зв'язки невизначеності 3. Критерії прийняття рішень в умовах повної невизначеності 4. Визначення суб'єкту ризику, видів та чинників ризику для українських підприємств 5. Втрати в умовах невизначеності й ризику.
Розділ 2 «Методологічні засади й інструментарій оцінювання економічних ризиків»			
<p>Тема 3. Системний аналіз економічних ризиків.</p> <p>Знати елементи ризику, ризикотворчі чинники, класифікацію ризиків, теорію корисності та її основні елементи.</p> <p>Вміти: аналізувати ризики та ризикотворчі чинники в практичній діяльності підприємства.</p> <p>Формування компетенцій: ПП8, ПП11</p> <p>Результати навчання: ПРН11</p> <p>Рекомендовані джерела: 1, 3–8</p>	Лекція 5	5,5*	Лекція-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 5		Мозковий шторм, навчальна дискусія, вирішення практичних задач
	Лекція 6		Лекція-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 6		Усне опитування, навчальна дискусія, доповідь з презентацією за тематикою самостійного вивчення дисципліни
			Круглий стіл на тему: «Оптимізація методів аналізу економічних ризиків підприємства»

<p>Тема 4. <i>Методичні засади кількісного аналізу ризику.</i></p> <p>Знати: загальну характеристику кількісних методів аналізу ризику; інваріантні методи аналізу: метод аналогій, аналіз чутливості, імітаційне моделювання, аналіз ризику можливих збитків; побудова дерева рішень як метода оцінювання ризику.</p> <p>Вміти: використовувати кількісні методи аналізу ризику в практичній діяльності.</p> <p>Формування компетенцій: ПП8, ПП11</p> <p>Результати навчання: ПРН11</p> <p>Рекомендовані джерела: 1, 3–8</p>	Лекція 7	5,5*	Лекція-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 7		Тестування, навчальна дискусія, вирішення практичних задач
	Лекція 8		Лекція-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 8		Усне опитування, навчальна дискусія, доповідь з презентацією за тематикою самостійного вивчення дисципліни
<p>Тема 5. <i>Спеціальні методи оцінювання ризику економічних суб'єктів.</i></p> <p>Знати: оцінювання фінансового ризику, оцінювання операційного ризику, метод аналізу доцільності витрат.</p> <p>Вміти: визначати та оцінювати фінансові та операційні ризики; використовувати на практиці метод аналізу доцільності витрат.</p> <p>Формування компетенцій: ПП8, ПП11</p> <p>Результати навчання: ПРН11</p> <p>Рекомендовані джерела: 1, 3–8</p>	Лекція 9	5,5*	Лекція-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 9		Усне опитування, навчальна дискусія, доповідь з презентацією за тематикою самостійного вивчення дисципліни
			Проведення модульного контролю № 2 «Методологічні засади й інструментарій оцінювання економічних ризиків»
<p>Тема 3. Системний аналіз економічних ризиків.</p> <p>Тема 4. Методичні засади кількісного аналізу ризику.</p> <p>Тема 5. Спеціальні методи оцінювання ризику економічних суб'єктів.</p>	Самостійна робота		<ol style="list-style-type: none"> 1. Обумовленість вибору методів оцінки ризиків. 2. Використання “дерева рішень” для обґрунтування господарських рішень. 3. Особливості кількісного аналізу ризику при ухваленні господарських рішень. 4. Обумовленість вибору методів оцінки ризиків. 5. Аналіз ризиків лізингових операцій. Моделювання ризику лізингових операцій. 6. Аналіз і моделювання кредитних ризиків. 7. Антикризове управління фірмою та ризик. 8. Багато критеріальний підхід до аналізу кредитного

			<p>ризиком комерційного банку.</p> <p>9. Валютні ризики та формування раціональної політики щодо їх страхування.</p> <p>10. Використання теорії корисності при формуванні валютного портфелю з урахуванням ризику.</p> <p>11. Експертні методи оцінки ризику в зовнішньоекономічній діяльності фірм.</p> <p>12. Застосування методу аналогій для кількісного оцінювання ризику.</p>
Розділ 3 «Управління ризиками. Система мінімізації та запобігання появи ризиків»			
<p>Тема 6. Мінімізація ризиків: основні заходи та процедури.</p> <p>Знати: організаційні засоби та прийоми впливу на ризик, економічні методи зниження ризику.</p> <p>Вміти: розробляти заходи, які пом'якшують вплив ризикових ситуацій на діяльність підприємства.</p> <p>Формування компетенцій: ПП8, ПП11</p> <p>Результати навчання: ПРН11</p> <p>Рекомендовані джерела: 1–8</p>	Лекція 10	5,5*	Лекція-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 10		Мозковий шторм, навчальна дискусія, обговорення ситуаційного завдання
	Лекція 11		Лекція-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 11		Усне опитування, навчальна дискусія, доповідь з презентацією за тематикою самостійного вивчення дисципліни
			Тестування, навчальна дискусія, вирішення практичних задач
<p>Тема 7. Управління економічними ризиками.</p> <p>Знати: сутність і зміст управління ризиками; система управління ризиками, загальна схема процесу управління ризиком.</p> <p>Вміти: враховувати взаємозв'язок прибутку і ризику при обґрунтуванні господарських рішень, формувати стратегії управління ризиком.</p> <p>Формування компетенцій: ПП8, ПП11</p> <p>Результати навчання: ПРН11</p> <p>Рекомендовані джерела: 1–8</p>	Лекція 12	5,5*	Лекція-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 12		Усне опитування, тестування, навчальна дискусія, обговорення ситуаційного завдання
			Лекція-візуалізація, експрес-опитування студентів
			Усне опитування, навчальна дискусія, доповідь з презентацією за тематикою самостійного вивчення дисципліни
			Проведення модульного контролю № 3 «Управління ризиками. Система мінімізації та запобігання появи ризиків»
<p>Тема 6. Мінімізація ризиків: основні заходи та процедури</p> <p>Тема 7. Управління економічними ризиками.</p>	Самостійна робота		<p>1. Розробка заходів щодо використання різних методів мінімізації ризиків</p> <p>2. Стратегічне управління ризиками</p> <p>3. Диверсифікація як метод управління ризиком.</p>

			4. Зовнішній борг України та ризик. 5. Ігровий підхід до управління валютним ризиком. 6. Управління інформаційними ризиками. 7. Управління фінансовим ризиком.
МАТЕРІАЛЬНО-ТЕХНІЧНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ ДИСЦИПЛІНИ			
<ul style="list-style-type: none"> • Мультимедійний проектор; • Комп'ютерний клас для проведення практичних занять. 			
ІНФОРМАЦІЙНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ ДИСЦИПЛІНИ			
<ol style="list-style-type: none"> 1. Офіційний вебпортал парламенту України. Законодавство України [Електронний ресурс] /Режим доступу: http://zakon2.rada.gov.ua/laws 2. Укл. М.А. Дядюк. «Управління ризиками». - 2017. http://www.dut.edu.ua/ua/lib/1/category/96/view/1869 3. С. Вінборн, В. Сисоєв, В. Ткаченко. «Посібник з оцінки корупційних ризиків та розробки планів протидії корупції». - 2015. http://www.dut.edu.ua/ua/lib/1/category/96/view/1826 4. Кучеренко В.Р., Карпов В.А., Карпов А.В.. «Економічний ризик та методи його вимірювання». - 2011. http://www.dut.edu.ua/ua/lib/1/category/96/view/1425 5. Під ред. Т.А. Васильєвої, Я.М. Кривич. «Економічний ризик: методи оцінки та управління». - 2015. http://www.dut.edu.ua/ua/lib/1/category/96/view/1424 6. В. М. Гранатуров, І.В. Литовченко. «Методи якісного аналізу підприємницьких ризиків». - 2005. http://www.dut.edu.ua/ua/lib/1/category/96/view/50 7. John Fraser, Betty J. Simkins. Enterprise risk management. JohnWiley & Sons, Inc. (2010). 8. S. Tkalenko, N. Sukurova. The influence of FDI on sustainable economic development of Ukraine in terms of global digitization. Journal of Digital Science, Vol.2, Iss.1. May, p.40-54. URL: https://ics.events/journal-of-digital-science/ (2020). 			
ПОЛІТИКА КУРСУ («ПРАВИЛА ГРИ»)			
<ul style="list-style-type: none"> • Курс передбачає роботу в колективі. • Середовище в аудиторії є дружнім, творчим, відкритим до конструктивної критики. • Освоєння дисципліни передбачає обов'язкове відвідування лекцій і практичних занять, а також самостійну роботу. • Самостійна робота включає в себе теоретичне вивчення питань, що стосуються тем лекційних занять, які не ввійшли в теоретичний курс, або ж були розглянуті коротко, їх поглиблена проробка за рекомендованою літературою. • Усі завдання, передбачені програмою, мають бути виконані у встановлений термін. • Якщо студент відсутній з поважної причини, він презентує виконані завдання під час самостійної підготовки та консультації викладача. • Під час роботи над завданнями не допустимо порушення академічної доброчесності: при використанні Інтернет ресурсів та інших джерел інформації студент повинен вказати джерело, використане в ході виконання завдання. У разі виявлення факту плагіату студент отримує за завдання 0 балів. • Студент, який спізнився, вважається таким, що пропустив заняття з неповажної причини з виставленням 0 балів за заняття, і при цьому має право бути присутнім на занятті. • За використання телефонів і комп'ютерних засобів без дозволу викладача, порушення дисципліни студент видаляється з заняття, за заняття отримує 0 балів. 			
*КРИТЕРІЇ ТА МЕТОДИ ОЦІНЮВАННЯ			
Умовою допуску до підсумкового контролю є набрання студентом 30 балів у сукупності за всіма темами дисципліни			
Форми контролю	Види навчальної роботи		Оцінювання
ПОТОЧНИЙ КОНТРОЛЬ	<i>Робота на заняттях, у т.ч.:</i>		
	• присутність на заняттях (при пропусках занять з поважних причин допускається відпрацювання пройденого матеріалу)		за кожне відвідування 0,55 бала
	• участь у експрес-опитуванні		за кожну правильну відповідь 0,25 бала

	<ul style="list-style-type: none"> • доповідь з презентацією за тематикою самостійного вивчення дисципліни (оцінка залежить від повноти розкриття теми, якості інформації, самостійності та креативності матеріалу, якості презентації і доповіді), підготовка реферату 	за кожну презентацію (реферат) максимум 3 бали
	<ul style="list-style-type: none"> • усне опитування, тестування, рішення практичних задач 	за кожну правильну відповідь 0,5 бала
	<ul style="list-style-type: none"> • участь у навчальній дискусії, обговоренні ситуаційного завдання 	за кожну правильну відповідь 2 бали
	<ul style="list-style-type: none"> • участь у діловій грі 	за кожну участь 1 бал
РУБІЖНЕ ОЦІНЮВАННЯ (МОДУЛЬНИЙ КОНТРОЛЬ)	Модульний контроль № 1 «Концептуальні основи ризикології в підприємстві»	максимальна оцінка – 10 балів
	Модульний контроль № 2 «Методологічні засади й інструментарій оцінювання економічних ризиків»	максимальна оцінка – 10 балів
	Модульний контроль № 3 «Управління ризиками. Система мінімізації та запобігання появи ризиків»	максимальна оцінка – 10 балів
Додаткова оцінка	Участь у наукових конференціях, підготовка наукових публікацій, участь у Всеукраїнських та Міжнародних конкурсах наукових студентських робіт за спеціальністю, створення кейсів тощо.	Звільняється від іспиту
ПІДСУМКОВЕ ОЦІНЮВАННЯ Іспит	Метою іспиту є контроль сформованості практичних навичок та професійних компетентностей, необхідних для виконання професійних обов'язків. Іспит проходить у письмовій формі.	30 балів

ПІДСУМКОВА ОЦІНКА ЗА ДИСЦИПЛІНУ

бали	Критерії оцінювання	Рівень компетентності	Оцінка /затис в екзаменаційній відомості
90-100	Студент демонструє повні й міцні знання навчального матеріалу в обсязі, що відповідає робочій програмі дисципліни, правильно й обґрунтовано приймає необхідні рішення в різних нестандартних ситуаціях. Вміє реалізувати теоретичні положення дисципліни в практичних розрахунках, аналізувати та співставляти дані об'єктів діяльності фахівця на основі набутих з даної та суміжних дисциплін знань та умінь. Знає сучасні технології та методи розрахунків з даної дисципліни. За час навчання при проведенні практичних занять, при виконанні індивідуальних / контрольних завдань проявив вміння самостійно вирішувати поставлені завдання, активно включатись в дискусії, може відстоювати власну позицію в питаннях та рішеннях, що розглядаються. Зменшення 100-бальної оцінки може бути пов'язане з недостатнім розкриттям питань, що стосується дисципліни, яка вивчається, але виходить за рамки об'єму матеріалу, передбаченого робочою програмою, або студент проявляє невпевненість в тлумаченні теоретичних положень чи складних практичних завдань.	Високий Повністю забезпечує вимоги до знань, умінь і навичок, що викладені в робочій програмі дисципліни. Власні пропозиції студента в оцінках і вирішенні практичних задач підвищує його вміння використовувати знання, які він отримав при вивченні інших дисциплін, а також знання, набуті при самостійному поглибленому вивченні питань, що відносяться до дисципліни, яка вивчається.	Відмінно / Зараховано (А)
90	Студент демонструє гарні знання, добре володіє матеріалом, що відповідає робочій програмі дисципліни, робить на їх основі аналіз можливих ситуацій та вміє застосовувати теоретичні положення при вирішенні практичних задач, але допускає окремі неточності. Вміє самостійно виправляти допущені помилки, кількість яких є незначною. Знає сучасні технології та методи розрахунків з даної дисципліни. За час навчання при проведенні практичних занять, при виконанні індивідуальних / контрольних завдань та поясненні прийнятих рішень, дає вичерпні пояснення.	Достатній Забезпечує студенту самостійне вирішення основних практичних задач в умовах, коли вихідні дані в них змінюються порівняно з прикладами, що розглянуті при вивченні дисципліни	Добре / Зараховано (В)

75-81	Студент в загальному добре володіє матеріалом, знає основні положення матеріалу, що відповідає робочій програмі дисципліни, робить на їх основі аналіз можливих ситуацій та вміє застосовувати при вирішенні типових практичних завдань, але допускає окремі неточності. Вміє пояснити основні положення виконаних завдань та дати правильні відповіді при зміні результату при заданій зміні вихідних параметрів. Помилки у відповідях/ рішеннях/ розрахунках не є системними. Знає характеристики основних положень, що мають визначальне значення при проведенні практичних занять, при виконанні індивідуальних / контрольних завдань та поясненні прийнятих рішень, в межах дисципліни, що вивчається.	Достатній Конкретний рівень, за вивченим матеріалом робочої програми дисципліни. Додаткові питання про можливість використання теоретичних положень для практичного використання викликають утруднення.	Добре / Зараховано (C)
64-74	Студент засвоїв основний теоретичний матеріал, передбачений робочою програмою дисципліни, та розуміє постанову стандартних практичних завдань, має пропозиції щодо напрямку їх вирішень. Розуміє основні положення, що є визначальними в курсі, може вирішувати подібні завдання тим, що розглядалися з викладачем, але допускає значну кількість неточностей і грубих помилок, які може усувати за допомогою викладача.	Середній Забезпечує достатньо надійний рівень відтворення основних положень дисципліни	Задовільно / Зараховано (D)
3 _і	Студент має певні знання, передбачені в робочій програмі дисципліни, володіє основними положеннями, що вивчаються на рівні, який визначається як мінімально допустимий. З використанням основних теоретичних положень, студент з труднощами пояснює правила вирішення практичних/розрахункових завдань дисципліни. Виконання практичних / індивідуальних / контрольних завдань значно формалізовано: є відповідність алгоритму, але відсутнє глибоке розуміння роботи та взаємозв'язків з іншими дисциплінами.	Середній Є мінімально допустимим у всіх складових навчальної програми з дисципліни	Задовільно / Зараховано (E)
9 _і	Студент може відтворити окремі фрагменти з курсу. Незважаючи на те, що програму навчальної дисципліни студент виконав, працював він пасивно, його відповіді під час практичних робіт в більшості є невірними, необґрунтованими. Цілісність розуміння матеріалу з дисципліни у студента відсутні.	Низький Не забезпечує практичної реалізації задач, що формуються при вивченні дисципліни	Незадовільно з можливістю повторного складання) / Не зараховано (FX) <i>В залікову книжку не проставляється</i>
4	Студент повністю не виконав вимог робочої програми навчальної дисципліни. Його знання на підсумкових етапах навчання є фрагментарними. Студент не допущений до здачі заліку.	Незадовільний Студент не підготовлений до самостійного вирішення задач, які окреслює мета та завдання дисципліни	Незадовільно з обов'язковим повторним вивченням / Не допущений (F) <i>В залікову книжку не проставляється</i>