

СИЛАБУС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ «УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ (RISK MANAGEMENT)»

Лектор курсу		Згурська Оксана Михайлівна, доктор економічних наук, доцент, доцент кафедри підприємництва, торгівлі та біржової діяльності		Контактна інформація лектора (e-mail), сторінка курсу в Moodle		e-mail: ptbd_dut@ukr.net ; сторінка курсу в Moodle – http://dl.dut.edu.ua/course/view.php?id=2061	
Освітній рівень				бакалавр			
Семестр				7			
Тип дисципліни				вибіркова			
Обсяг:	Кредитів ECTS	Годин	За видами занять:				
			Лекцій	Семінарських занять	Практичних занять	Лабораторних занять	Самостійна підготовка
	5	150	-	-	72	-	78

АНОТАЦІЯ КУРСУ

Взаємозв'язок у структурно-логічній схемі

Мета курсу: формування у студентів необхідної системи знань щодо вільного володіння професійною англійською мовою з питань визначення, обґрунтування та ефективного управління ризиками телекомунікаційного підприємства в умовах ринкової економіки, поглиблення та розширення економічних знань в цілому, які є необхідними для вирішення професійних завдань щодо ефективного управління підприємницькою діяльністю в умовах конкурентного середовища.

Компетенції відповідно до освітньо-професійної програми

Soft- skills / Загальні компетентності (ЗК)	Hard-skills / Спеціальні (фахові) компетенції
<p>ЗК2. Здатність застосовувати отримані знання в практичних ситуаціях.</p> <p>ЗК8. Здатність виявляти ініціативу та підприємливість.</p> <p>ЗК10. Здатність діяти відповідально та свідомо.</p>	<p>СК2. Здатність обирати та використовувати відповідні методи, інструментарій для обґрунтування рішень щодо створення, функціонування підприємницьких, торговельних і біржових структур.</p> <p>СК7. Здатність визначати і виконувати професійні завдання з організації діяльності підприємницьких, торговельних та біржових структур.</p> <p>СК10. Здатність до бізнес-планування, оцінювання кон'юнктури ринків і результатів діяльності у сфері підприємництва, торгівлі та біржової практики з урахуванням ризиків.</p>

Результати навчання відповідно до освітньо-професійної (програмні результати навчання – ПРН)

ПРН2. Застосовувати набуті знання для виявлення, постановки та вирішення завдань за різних практичних ситуацій в підприємницькій, торговельній та біржовій діяльності.

ПРН7. Демонструвати підприємливість в різних напрямках професійної діяльності та брати відповідальність за результати.

ПРН17. Вміти вирішувати професійні завдання з організації діяльності підприємницьких, торговельних та біржових структур і розв'язувати проблеми у кризових ситуаціях з урахуванням зовнішніх та внутрішніх впливів.

ПРН20. Демонструвати вміння бізнес-планування, оцінювання кон'юнктури ринків та результатів діяльності підприємницьких, торговельних і біржових структур з урахуванням ризиків.

ОРГАНІЗАЦІЯ НАВЧАННЯ

Тема, опис теми	Вид заняття	Тиждень семестру	Форми і методи навчання/питання до самостійної роботи
-----------------	-------------	------------------	---

Розділ 1. ТЕОРЕТИЧНІ ОСНОВИ УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ.

<p>Тема 1. Загальні основи управління ризиками. Класифікація ризику та основні підходи до управління ним. Знати: теоретичний аспект сутності управління підприємницькими ризиками. Системні характеристики управління підприємницькими ризиками. Вміти: виявляти загальні проблеми постановки головних цілей управління ризиками. Аналізувати ризики. Виявляти основні причини виникнення ризику. Формування компетенцій: ЗК2, ЗК8, ЗК10, СК2, СК7 Результати навчання: ПРН2, ПРН7 Рекомендовані джерела: 1-4</p>	Практичне заняття 1	5,5*	Усне опитування, тестування, навчальна дискусія, обговорення ситуаційного завдання
	Практичне заняття 2		Практичне заняття-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 3		Усне опитування, навчальна дискусія, доповідь з презентацією за тематикою самостійного вивчення дисципліни
	Практичне заняття 4		Практичне-заняття-візуалізація, експрес-опитування студентів
<p>Тема 2. Сутність підприємницького ризику. Характеристика ризиків виробничого підприємства. Знати: теоретичний аспект сутності підприємницького ризику. Причини виникнення підприємницького ризику. Функції підприємницького ризику. Вміти: здійснювати оцінку ризиків відсутності попиту на вироблену продукцію; ризиків невиконання господарських договорів (контрактів); ризиків посилення конкуренції. Формування компетенцій: ЗК2, ЗК8, ЗК10, СК2, СК7 Результати навчання: ПРН2, ПРН7 Рекомендовані джерела: 2-4</p>	Практичне заняття 5	5,5	Практичне заняття-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 6		Усне опитування, тестування, тематична дискусія, рішення практичних задач «Графічне визначення та характеристика елементів формування фінансових ресурсів»
	Практичне заняття 7		Практичне заняття-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 8		Усне опитування, навчальна дискусія, доповідь з презентацією за тематикою самостійного вивчення дисципліни
<p>Тема 3. Сутність фінансового ризику. Інвестиційні ризики. Знати: теоретичний аспект сутності управління підприємницькими ризиками. Системні характеристики управління підприємницькими ризиками. Вміти: аналізувати ризики. Виявляти основні причини виникнення ризику. Формування компетенцій: ЗК2, ЗК8, ЗК10, СК2, СК7 Результати навчання: ПРН2, ПРН7 Рекомендовані джерела: 1-5</p>	Практичне заняття 9	5,5*	Практичне заняття-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 10		Усне опитування, навчальна дискусія, доповідь з презентацією за тематикою самостійного вивчення дисципліни.
	Практичне заняття 11		Практичне заняття-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 12		Проведення модульного контролю №1 «Теоретичні основи управління ризиками»
<p>Тема 4. Управлінський ризик та теорія корисності. Знати: загальні засади та концепція теорії корисності. Корисність за Нейманом. Сподівана корисність. Вміти: будувати криві байдужості. Застосовувати функцію корисності з інтервальною нейтральністю. Формування компетенцій: ЗК2, ЗК8, ЗК10, СК2, СК7 Результати навчання: ПРН2, ПРН7, ПРН17 Рекомендовані джерела: 2-7</p>	Практичне заняття 13	5,5*	Практичне заняття-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 14		Усне опитування, рішення задач «Корисність за Нейманом»
	Практичне заняття 15		Практичне-заняття-візуалізація, експрес-опитування студентів
			Усне опитування, ділова гра «Побудова схеми ставлення до ризику та корисність»

	Практичне заняття 16		Практичне заняття-візуалізація, експрес-опитування студентів
<p>Тема 1. Підходи до класифікації ризиків. Функції ризику. Класифікація ризику та основні підходи до управління ним.</p> <p>Тема 2. Сутність підприємницького ризику та причини його виникнення. Особливості прояву ризику в сучасних умовах.</p> <p>Тема 3. Принципи оцінки ефективності інвестиційних проектів.</p> <p>Тема 4. Основні шляхи і методи оптимізації підприємницьких ризиків.</p>	Самостійна робота		<p>..</p> <p>1. Основні підходи до процесу управління ризиками виробничого підприємства. Ідентифікація різних видів ризиків за класифікаційними ознаками.</p> <p>2. Врахування ризику інфляції в оцінюванні довготермінових інвестиційних проектах.</p> <p>3. Програма управління ризиками на підприємстві. Застосування методу аналогій для кількісного оцінювання ризику.</p>
Розділ 2. МЕТОДИ УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ ТА ШЛЯХИ ЇХ МІНІМІЗАЦІЇ			
<p>Тема 5. Загальні методи управління ризиком та шляхи його мінімізації. Знати: різноманітність методів управління ризиком. Диверсифікація як засіб зниження ризику. Вміти: застосовувати основні принципи та методи передачі ризику. Формування компетенцій: ЗК2, ЗК8, ЗК10, СК2, СК7 Результати навчання: ПРН2, ПРН7, ПРН17 Рекомендовані джерела: 4-7</p>	Практичне заняття 17	5,5*	Практичне заняття-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 18		Усне опитування, навчальна дискусія, візуалізація піндивідуальних проектів
	Практичне заняття 19		Практичне заняття-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 20		Усне опитування, навчальна дискусія, доповідь з презентацією за тематикою самостійного вивчення дисципліни
<p>Тема 6. Обґрунтування підприємством стратегії управління ризиками. Особливості системи кількісних оцінок ризику. Знати: сутність та механізм залучення позикового капіталу підприємства.. Вміти: розробляти та характеризувати основні етапи розробки проекту залучення підприємством позичкових коштів Формування компетенцій: ЗК2, ЗК8, ЗК10, СК2, СК7 Результати навчання: ПРН2, ПРН7, ПРН17 Рекомендовані джерела: 5-7</p>	Практичне заняття 21	5,5*	Практичне заняття-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 22		Усне опитування, навчальна дискусія «Диверсифікація портфеля цінних паперів».
	Практичне заняття 23		Практичне заняття - візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 24		Усне опитування, навчальна дискусія за темою: «Застосування спрощеної класичної моделі формування портфеля цінних паперів».
<p>Тема 7. Портфельні ризики. Знати: сутність управління портфелем цінних паперів. Ризик цінних паперів. Вміти: використовувати загальні аспекти формування портфеля цінних паперів та оптимізувати його структуру. Формування компетенцій: ЗК2, ЗК8, ЗК10, СК2, СК7, СК10 Результати навчання: ПРН2, ПРН7, ПРН17, ПРН20 Рекомендовані джерела: 2-8</p>	Практичне заняття 25	5,5*	Практичне заняття-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 26		Усне опитування, навчальна дискусія «Кореляція цінних паперів та її застосування».
	Практичне заняття 27		Практичне заняття - візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 28		Усне опитування, навчальна дискусія, доповідь з презентацією за тематикою самостійного вивчення дисципліни
<p>Тема 8. Ризики у банківському підприємстві. Знати: види та особливості ризиків у банківському підприємстві.</p>	Практичне заняття 29	5,5*	Практичне заняття-візуалізація, експрес-опитування студентів

<p>Вміти: характеризувати кредитний ризик, валютний ризик, ринковий ризик, лізинговий ризик, факторинговий ризик, депозитний ризик, відсотковий ризик. Формування компетенцій: ЗК2, ЗК8, ЗК10, СК2, СК7, СК10 Результати навчання: ПРН2, ПРН7, ПРН17, ПРН20 Рекомендовані джерела: 4-8</p>	Практичне заняття 30		Усне опитування, навчальна дискусія «Вибір організаційної структури підприємства у відповідності із особливостями ризиків вибору та надійності партнера».
	Практичне заняття 31		Практичне заняття - візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 32		Усне опитування, навчальна дискусія, доповідь з презентацією за тематикою самостійного вивчення дисципліни
<p>Тема 9. Ризики в зовнішньоекономічній діяльності суб'єкта господарювання. Знати: зміст та особливості основних видів ризиків ЗЕД. Ризик, що пов'язаний з вибором країни здійснення ЗЕД. Вміти: Характеризувати ризики, що пов'язані з основними положеннями зовнішньоторговельного контракту. Формування компетенцій: ЗК2, ЗК8, ЗК10, СК2, СК7, СК10 Результати навчання: ПРН2, ПРН7, ПРН17, ПРН20 Рекомендовані джерела: 3-8</p>	Практичне заняття 33	6,0*	Практичне заняття-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 34		Усне опитування, навчальна дискусія, доповідь з презентацією за тематикою самостійного вивчення дисципліни.
	Практичне заняття 35		Практичне заняття-візуалізація, експрес-опитування студентів
	Практичне заняття 36		Проведення модульного контролю №2 «Методи управління ризиком та шляхи його мінімізації»
<p>Тема 5. Диверсифікація як засіб зниження ризику. Тема 6. Аналіз ефективності інвестиційної стратегії підприємства. Тема 7. Портфель з двох різних акцій. Портфель з багатьох акцій. Тема 8. Ризик незбалансованої ліквідності та зовнішні ризики. Тема 9. Транспортні ризики.</p>	Самостійна робота		<ol style="list-style-type: none"> 1. Аналіз особливостей підгалузей національної економіки щодо інвестицій. 2. Загальні аспекти формування портфеля цінних паперів. 3. Методи страхування ризиків. 4. Ефективні шляхи зниження ризиків. 5. Функція корисності з інтервальною нейтральністю.. 6. Ризики незбалансованої ліквідності та зовнішні ризики.. 7. Кореляція цінних паперів відповідно до виду підприємницького ризику.

МАТЕРІАЛЬНО-ТЕХНІЧНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ ДИСЦИПЛІНИ

- Комп'ютери с програмним забезпеченням для виконання практичних робіт: Goledocs, Googleanalytics, GoogleTrends – формування та ефективного використання власного та залученого капіталу; Microsoft Power BI, Microsoft Visio, Microsoft PowerPoint – аналітика та візуалізація даних; HohliBuilder, GoogleCharts, Vizualize-онлайн сервіси для створення інфографіки; Microsoft Project, Spider Project Lite, OpenProj, GanttProject, Microsoft Excel – управління проектами; М.Е.Doc, АППОД, СЕД Діло, Microsoft Excel, Microsoft Word, Microsoft Outlook – документообіг
- Мультимедійний проектор, маркерна дошка і екран;
- Система дистанційного навчання і контролю Moodle – <http://dl.dut.edu.ua>

ІНФОРМАЦІЙНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ ДИСЦИПЛІНИ

1. Управління ризиками (Risk Management). Навчально-методичні матеріали в системі Moodle. URL: <http://dl.dut.edu.ua/course/view.php?id=572>
2. Deirdre Sartorelli. A Handbook for Entrepreneurs. URL: http://www.dut.edu.ua/uploads/1_1949_88506300.pdf
3. Valerie Mocker, Simona Bielli and Christopher Haley. WINNING TOGETHER A GUIDE TO SUCCESSFUL CORPORATE-STARTUP COLLABORATIONS – http://www.dut.edu.ua/uploads/1_1945_81044759.pdf
4. Tendayi Viki Dan Toma Esther Gons. The Corporate Startup. URL: http://www.dut.edu.ua/uploads/1_1948_10765211.pdf

5. Blum Daniel. Rational Cybersecurity for Business: The Security Leaders' Guide to Business Alignment. Apress Media LLC., 2020. 359 p. ISBN-13 (electronic): 978-1-4842-5952-8. URL: http://www.dut.edu.ua/uploads/1_2078_72565123.pdf
6. A.J. Antonites & R. Wordsworth. Risk tolerance: A perspective on entrepreneurship education. Southern African Business Review Volume 13 Number 3, 2009. URL: http://www.dut.edu.ua/uploads/1_1861_22795151.pdf
7. Hubbard D.W., Seiersen R. How to Measure Anything in Cybersecurity Risk. Wiley, 2016. 304 p. ISBN: 1119085292, 9781119085294. URL: http://www.dut.edu.ua/uploads/1_2077_77796609.pdf
8. Hackel Kenneth S. Security Valuation and Risk Analysis: Assessing Value in Investment Decision-Making. McGraw-Hill, 2010. 624 p. ISBN: 0071744355, 9780071744355. URL: http://www.dut.edu.ua/uploads/1_2074_33193083.pdf

ПОЛІТИКА КУРСУ («ПРАВИЛА ГРИ»)

- 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.

КРИТЕРІЙ ТА МЕТОДИ ОЦІНЮВАННЯ

Форми контролю	Види навчальної роботи	Оцінювання
ПОТОЧНИЙ КОНТРОЛЬ	Робота на практичних заняттях, у т.ч.:	
	• 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
	• доповідь з презентацією за тематикою самостійного вивчення дисципліни (оцінка залежить від повноти розкриття теми, якості інформації, самостійності та креативності матеріалу, якості презентації і доповіді)	за кожну презентацію (реферат) максимум 3 бали
	• усне опитування, тестування, рішення практичних задач	за кожну правильну відповідь 0,5 бала
	• участь у навчальній дискусії, обговоренні ситуаційного завдання	за кожну правильну відповідь 2 бали
	• участь у діловій грі	за кожну участь 1 бал
РУБІЖНЕ ОЦІНЮВАННЯ (МОДУЛЬНИЙ КОНТРОЛЬ)	Модульний контроль № 1 «Теоретичні основи управління ризиками»	максимальна оцінка – 10 балів
	Модульний контроль № 2 «Методи управління ризиками та шляхи їх мінімізації»	максимальна оцінка – 10 балів
Додаткова оцінка	Участь у наукових конференціях, підготовка наукових публікацій, у т.ч. на англійській мові, участь у Всеукраїнських конкурсах наукових студентських робіт за спеціальністю, створення кейсів тощо.	Звільняється від іспиту
ПІДСУМКОВЕ ОЦІНЮВАННЯ залік	Метою заліку є контроль сформованості практичних навичок та професійних компетентностей, необхідних для виконання професійних обов'язків. Залік проходить у формі співбесіди.	30 балів
бали	Критерії оцінювання	Рівень компетентності
		Оцінка /зачис в екзаменаційній

			<i>відомості</i>
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 стосуються 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)
82-89	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 (С)
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)
60-63	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 (Е)
35-59	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 відсутня.	Низький Не забезпечує практичної реалізації задач, що формуються при вивченні дисципліни	Незадовільно з можливістю повторного складання) / Не зараховано (FХ) <i>В залікову книжку не представляється</i>
1-34	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 представляється</i>