

**МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ДВНЗ «ПРИКАРПАТСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ІМЕНІ ВАСИЛЯ СТЕФАНІКА»**

Факультет/інститут економічний

Кафедра економічної кібернетики

СИЛАБУС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Ризик-менеджмент

Освітня програма Економіка

Спеціальність 051 Економіка

Галузь знань 05 Соціальні та поведінкові науки

Затверджено на засіданні кафедри
Протокол № 1 від 29 серпня 2019 р.

ЗМІСТ

1. Загальна інформація
2. Анотація до курсу
3. Мета та цілі курсу
4. Результати навчання (компетентності)
5. Організація навчання курсу
6. Система оцінювання курсу
7. Політика курсу
8. Рекомендована література

1. Загальна інформація	
Назва дисципліни	Ризик-менеджмент
Викладач (-і)	к.е.н. Судук Н.В.
Контактний телефон викладача	+38(097)2280838
E-mail викладача	natalia.suduk@pnu.edu.ua
Формат дисципліни	Очний
Обсяг дисципліни	6 кредитів ECTS
Посилання на сайт дистанційного навчання	
Консультації	Очні консультації: згідно розкладу консультацій
2. Анотація до курсу	
<p>Вивчення дисципліни “Ризик-менеджмент” передбачає формування навичок управління ризиками та прийняття відповідних рішень у сфері ризик-менеджменту, закріплення та поглиблення теоретичних знань з управління ризиками. Вивчення та облік невизначеності, конфліктності, багатокритеріальності й пов’язаного з ними ризику є важливим напрямом сучасної економічної теорії. Об’єкт управління ситуацією характеризується багатоваріантністю розвитку та можливістю виникнення непередбачених ситуацій. Таким чином, основними характеристиками сучасного економіста є уміння працювати в умовах невизначеності, робити раціональний вибір із безлічі можливих альтернатив.</p>	
3. Мета та цілі курсу	
<p>Мета викладання дисципліни – формування у студентів сучасного рівня знань щодо методології управління ризиком та оволодіння практичним інструментарієм застосування прийомів і методів зниження ризику та створювання умов безпеки діяльності суб’єкту господарювання.</p> <p>Основними цілями навчальної дисципліни є:</p> <ul style="list-style-type: none"> – вивчення основних прийомів і методів управління ризиками; – набуття навиків проведення оцінки ризиків різних аспектів функціонування економічної системи; – набуття навиків аналізу отриманих результатів і розробки відповідних управлінських рішень; – формування знань і навичок щодо використання найефективніших форм і методів оцінки величини економічного ризику і шляхів мінімізації його величини. <p>У результаті вивчення навчальної дисципліни студент повинен:</p> <p>знати: понятійний та категорійний апарат ризик-менеджменту; зміст невизначеності та ризиків та основні фактори, що впливають на ризики; сутність основних підходів до визначення ризиків; основні закони та принципи ризик-менеджменту; методологію ризик-менеджменту; особливості управління зовнішніми та внутрішніми ризиками; технологію прийняття управлінських рішень в умовах ризику та невизначеності; сутність системи управління ризиками.</p> <p>вміти: характеризувати необхідність здійснення ризик-менеджменту; визначати зовнішні та внутрішні фактори, що впливають на ризики в умовах невизначеності; ідентифікувати ризики за основними класифікаційними ознаками; характеризувати закони і принципи ризик-менеджменту; обґрунтовувати методи управління ризиками; характеризувати причини виникнення зовнішніх та внутрішніх ризиків та їх особливості управління; здійснювати процедуру підготовки, прийняття та реалізації управлінських рішень в умовах невизначеності та ризику; визначати основні елементи системи управління ризиками.</p>	
4. Результати навчання (компетентності)	
<p>Результати навчання:</p> <p>4. Розуміти принципи економічної науки, особливості функціонування економічних систем.</p> <p>5. Застосовувати аналітичний та методичний інструментарій для обґрунтування пропозицій та прийняття управлінських рішень різними економічними агентами (індивідуумами, домогосподарствами, підприємствами та органами державної влади).</p> <p>12. Застосовувати набуті теоретичні знання для розв’язання практичних завдань та</p>	

змістовно інтерпретувати отримані результати.

17. Виконувати міждисциплінарний аналіз соціально-економічних явищ і проблем в одній або декількох професійних сферах з врахуванням ризиків та можливих соціально-економічних наслідків.

21. Вміти абстрактно мислити, застосовувати аналіз та синтез для виявлення ключових характеристик економічних систем різного рівня, а також особливостей поведінки їх суб'єктів.

22. Демонструвати гнучкість та адаптивність у нових ситуаціях, у роботі із новими об'єктами, та у невизначених умовах.

Компетентності:

ІК - Здатність розв'язувати складні спеціалізовані задачі та практичні проблеми в економічній сфері, які характеризуються комплексністю та невизначеністю умов, що передбачає застосування теорій та методів економічної науки.

ЗК3. Здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу.

ЗК4. Здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях.

ЗК9. Здатність до адаптації та дій в новій ситуації.

ЗК10. Здатність бути критичним і самокритичним.

ЗК11. Здатність приймати обґрунтовані рішення.

СК8. Здатність аналізувати та розв'язувати завдання у сфері економічних та соціально-трудоових відносин.

СК12. Здатність самостійно виявляти проблеми економічного характеру при аналізі конкретних ситуацій, пропонувати способи їх вирішення.

СК14. Здатність поглиблено аналізувати проблеми і явища в одній або декількох професійних сферах з врахуванням економічних ризиків та можливих соціально-економічних наслідків.

5. Організація навчання курсу

Обсяг курсу - 180 год.

Вид заняття	Загальна кількість годин
Лекції	24
Практичні	36
Самостійна робота	120

Ознаки курсу

Семестр	Спеціальність	Курс (рік навчання)	Обов'язковий / вибірковий
7	051 Економіка	IV	Цикл професійної підготовки Вибіркові дисципліни

Тематика курсу

Тема, план	Форма заняття	Літера тура	Завдання, год	Вага оцінки	Термін виконання
Тема 1. Сутність, зміст і види ризиків. Сутність ризику та причини його виникнення. Функції ризику. Класифікаційна система ризиків. Групи, категорії, види, підвиди і різновиди ризиків.	Лекція, практичне заняття	[1, 4, 5, 12, 14, 18]	Опрацювати лекційний матеріал, підготуватися до практичного заняття	0,1	До наступного заняття за розкладом
Тема 2. Система управління ризиками. Сучасна концепція управління підприємницькими ризиками та її складові. Концепція прийнятного ризику. Мета за завдання управління ризиком. Сутність та структурна будова системи управління ризиками на підприємстві. Функції системи управління ризиком. Методичні підходи до побудови	Лекція, практичне заняття	[1 – 3, 6, 17, 18]	Опрацювати лекційний матеріал, підготуватися до практичного	0,1	До наступного заняття за розкладом

комплексної системи ризик-менеджменту на підприємстві. Технологія управління ризиками на підприємстві.			заняття		
Тема 3. Стратегія, політика та тактика управління ризиками. Сутність та правила побудови стратегії ризик-менеджменту. Форми та зміст тактичного управління ризиком. Програма ризик-менеджменту на підприємстві. Етапи реалізації програми ризик-менеджменту на підприємстві.	Лекція, практичне заняття	[1, 14, 16, 18]	Опрацювати лекційний матеріал, підготуватися до практичного заняття	0,1	До наступного заняття за розкладом
Тема 4. Операційний та інвестиційний ризик-менеджмент. Особливості виявлення операційних ризиків. Основні принципи розробки інвестиційної стратегії з урахуванням ризику. Методи оцінки інвестиційних проектів з урахуванням ризику. Ризик щодо прийняття інвестиційних рішень.	Лекція, практичне заняття	[1, 7, 9, 12, 16]	Опрацювати лекційний матеріал, підготуватися до практичного заняття	0,1	До наступного заняття за розкладом
Тема 5. Ризик-менеджмент у сфері фінансів. Суть та класифікація фінансового ризику. Принципи управління фінансовими ризиками. Схема управління фінансовими ризиками. Методи впливу на фінансові ризики.	Лекція, практичне заняття	[1, 7, 9, 12, 16]	Опрацювати лекційний матеріал, підготуватися до практичного заняття	0,1	До наступного заняття за розкладом
Тема 6. Ризик-менеджмент у маркетингу. Ризики в маркетингу. Управління ризиками під час маркетингових досліджень.	Лекція, практичне заняття	[1, 7, 12, 16]	Опрацювати лекційний матеріал, підготуватися до практичного заняття	0,1	До наступного заняття за розкладом
Тема 7. Ризик-менеджмент у сфері зовнішньоекономічної діяльності. Основні види ризиків у зовнішньоекономічній діяльності. Практичні аспекти аналізу і розрахунку ризиків на етапі підготовки зовнішньоекономічної операції.	Лекція, практичне заняття	[1, 7, 12, 14, 16]	Опрацювати лекційний матеріал, підготуватися до практичного заняття	0,1	
Тема 8. Міжнародні стандарти у процесі управління ризиками суб'єктів господарювання. Характеристика світових стандартів ризик-менеджменту.	Лекція, практичне заняття	[19-21]	Опрацювати лекційний матеріал	0,1	До наступного заняття за розкладом

Призначення та основні положення Міжнародного управління ризиком ISO 31000. Призначення та основні положення Міжнародного управління ризиком FERMA.			матеріал, підготуватися до практичного заняття, пройти тестування до попередніх тем		
Підсумкове практичне заняття	Практичне заняття		Підготуватись до контрольної роботи	0,2	Згідно розкладу

6. Система оцінювання курсу

Загальна система оцінювання курсу	<p>100 бальна – 50 балів протягом семестру та 50 балів за екзамен;</p> <p>“відмінно” – студент демонструє повні і глибокі знання навчального матеріалу, достовірний рівень розвитку умінь та навичок, правильне й обґрунтоване формулювання практичних висновків, наводить повний обґрунтований розв’язок прикладів та задач, аналізує причинно-наслідкові зв’язки; вільно володіє науковими термінами;</p> <p>“добре” – студент демонструє повні знання навчального матеріалу, але допускає незначні пропуски фактичного матеріалу, вміє застосувати його до розв’язання конкретних прикладів та задач, у деяких випадках нечітко формулює загалом правильні відповіді, допускає окремі несуттєві помилки та неточності в розв’язках;</p> <p>“задовільно” – студент володіє більшою частиною фактичного матеріалу, але викладає його не досить послідовно і логічно, допускає істотні пропуски у відповідях, не завжди вміє правильно застосувати набуті знання до розв’язання конкретних прикладів та задач, нечітко, а інколи й невірно формулює основні твердження та причинно-наслідкові зв’язки;</p> <p>“незадовільно” – студент не володіє достатнім рівнем необхідних знань, умінь, навичок, науковими термінами.</p>
Вимоги до письмової роботи	Відповідно до навчального плану, студент виконує одну контрольну роботу, яка є допуском до складання іспиту. Головна її мета – перевірка самостійної роботи студентів в процесі навчання, виявлення ступеня засвоєння ними теоретичних положень курсу. При розв’язанні задач студент має детально вказувати, яким саме був хід його роздумів, якими формулами він користувався.
Семінарські заняття	Практичне заняття проводиться з метою формування у студентів умінь і навичок з предмету, вирішення сформульованих завдань, їх перевірка та оцінювання. За метою і структурою практичні заняття є ланцюжком, який пов’язує теоретичне навчання і навчальну практику з дисципліни, а також передбачає попередній контроль знань студентів. Оцінка за практичне заняття враховується при виставленні підсумкової оцінки з дисципліни.
Умови допуску до підсумкового контролю	<ul style="list-style-type: none"> – оцінка за поточне тестування (10 балів); – оцінка за відповіді на всі основні та додаткові запитання під час аудиторних занять (15 балів); – оцінка за контрольну роботу (15 балів); – оцінка за самостійну роботу (10 балів).

7. Політика курсу

- самостійне виконання навчальних завдань, завдань поточного та підсумкового контролю результатів навчання (для осіб з особливими освітніми потребами ця вимога застосовується з урахуванням їхніх індивідуальних потреб і можливостей);
- посилання на джерела інформації у разі використання ідей, розробок, тверджень,

відомостей;

- надання достовірної інформації про результати власної навчальної (наукової, творчої) діяльності, використані методики досліджень і джерела інформації.

Засвоєння пропущеної теми лекції з поважної причини перевіряється під час складання підсумкового контролю. Пропуск лекції з неповажної причини відпрацьовується студентом відповідно до вимог кафедри, що встановлені на засіданні кафедри (співбесіда, реферат тощо).

Пропущені практичні, семінарські та лабораторні заняття, незалежно від причини пропуску, студент відпрацьовує згідно з графіком консультацій. Поточні „2”, отримані студентом під час засвоєння відповідної теми на практичному, семінарському та лабораторному занятті перескладаються викладачеві, який веде заняття до складання підсумкового контролю з обов'язковою відміткою у журналі обліку роботи академічних груп.

8. Рекомендована література

1. Старостіна А.О. Ризик-менеджмент: теорія та практика: навч. посіб. / А.О. Старостіна, В.А. Кравченко. – К. : ІВЦ «Видавництво «Політехніка», 2004. – 200 с.
2. Останкова Л.А. Аналіз, моделювання та управління економічними ризиками : навч. посіб. / Л.А. Останкова, Н.Ю. Шевченко. – К. : Центр учбової літератури, 2011. – 256 с.
3. Вітлінський В.В. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком : навч.-метод. посібник для самост. вивч. дисц. / В.В. Вітлінський, П. І. Верченко. – К. : КНЕУ 2001. – 292 с.
4. Івченко І. Ю. Економічні ризики : Навчальний посібник / І. Ю. Івченко. – К. : „Центр навчальної літератури”, 2004. – 304 с.
5. Ілляшенко С. М. Економічний ризик : Навчальний посібник / С. М. Ілляшенко. – К. : Центр навчальної літератури, 2004. – 220 с.
6. Матвійчук А. В. Аналіз і управління економічним ризиком : навч. посіб. / А.В. Матвійчук. – К. : Центр навчальної літератури, 2005. – 224 с.
7. Машина Н. І. Економічний ризик та методи його вимірювання : навч. посіб. / Н.І. Машина. – К. : Центр навчальної літератури, 2003. – 188 с.
8. Федорова В.О. Аналіз, вимірювання, оцінка ризиків підприємницької діяльності / В.О. Федорова, А.Б. Кондрашихін. – Севастополь : Підприємствореєстратор «Світок», 2006. – 99 с.
9. Азаренкова Г.М. Аналіз моделювання і управління ризиком (у схемах та прикладах) : навч. посіб. / Г.М. Азаренкова. – Львів : Новий світ-2000, 2011. – 240 с.
10. Донець Л.І. Економічні ризики та методи їх вимірювання : навч. посіб. / Л.І. Донець. – Київ : Центр навчальної літератури, 2006. – 312 с.
11. Чорноморченко Н.В. Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків : навч.-метод. посібник для сам. вивчення дисц. / Н.В. Чорноморченко, І.С. Іванова, Н.С. Приймак. – Львів : Магнолія-2006, 2010. – 260 с.
12. Шегда А.В. Ризики в підприємстві: оцінювання та управління : навч. посіб. / А. В. Шегда, М. В. Голованенко ; за ред. А.В. Шегди. – Київ : Знання, 2008. – 271 с.
13. Верченко П.І. Багатокритеріальність і динаміка економічного ризику (моделі та методи) : монографія / П.І. Верченко. – Київ : КНЕУ, 2006. – 272 с.
14. Вітлінський В.В. Ризикологія в економіці та підприємстві : Монографія / В.В. Вітлінський, Г.І. Великоіваненко. – К. : КНЕУ, 2004. – 480 с.
15. Внукова Н.М. Економічна оцінка ризику діяльності підприємств : проблеми теорії та практики / Н.М. Внукова, В.А. Смоляк. – Харків : ВД «ІНЖЕК», 2006. – 181 с.
16. Гранатуров В.М. Аналіз підприємських ризиків: проблеми визначення, класифікації та кількісної оцінки / Гранатуров В. М., Литовченко І. В., Харічков С. К. – Одеса, 2003. – 164 с.
17. Лещинський О. Л. Економічний ризик та методи його вимірювання : навч. посіб. для студентів вищих навчальних закладів / О.Л. Лещинський, О.В. Шкільний. – К. : Дельта, 2005. – 112 с.
18. Лук'янова В. В. Економічний ризик : навч. посіб. / В.В. Лук'янова, Т.В. Головач. – К. : Академвидав, 2007. – 462 с.
19. Дядюк М. А. Управління ризиками: консп. лекц. Харків: Форт, 2017. С. 165 URL: <http://elib.hduht.edu.ua/jspui/handle/123456789/1893>.
20. Посохов І.М. Сучасні міжнародні стандарти ризик-менеджменту / І.М. Посохов // Сучасні тенденції розвитку світової економіки: зб. матеріалів 9-ї Міжнар. наук.-практ. конф. – Харків : ХНАДУ, 2017. – Т. 2. – С. 77-78.
21. Гончар Г.П. Адаптація світових стандартів ризик-менеджменту до діяльності

Викладач

Судук Н.В.