

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



Факультет/інститут економічний

Кафедра економічної кібернетики

СИЛАБУС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Ризик менеджмент

Освітня програма Економіка\Економічна кібернетика

Спеціальність 051 Економіка

Галузь знань 05 Соціальні та поведінкові науки

Затверджено на засіданні кафедри
економічної кібернетики
Протокол № 2 від “29” серпня 2023 р.

м. Івано-Франківськ – 2023 р.

ЗМІСТ

1. Загальна інформація	3
2. Опис дисципліни	3
3. Структура курсу	4
4. Система оцінювання курсу	6
5. Оцінювання відповідно до графіку навчального процесу	6
6. Ресурсне забезпечення	6
7. Контактна інформація	7
8. Політика навчальної дисципліни	7

1. Загальна інформація

Назва дисципліни	Ризик менеджмент
Освітня програма	Економіка\Економічна кібернетика
Спеціалізація (за наявності)	
Спеціальність	051 Економіка
Галузь знань	05 Соціальні та поведінкові науки
Освітній рівень	бакалавр
Статус дисципліни	основна
Курс / семестр	4\7
Розподіл за видами занять та годинами навчання (якщо передбачені інші види, додати)	Лекції – 12 год. Практичні заняття – 18 год. Самостійна робота – 60 год.
Мова викладання	українська
Посилання на сайт дистанційного навчання	https://d-learn.pnu.edu.ua/course/subscription/through/url/2ccfcac4d5222ccb55ca

2. Опис дисципліни

Мета та цілі курсу

Мета формування системи теоретичних знань і практичних умінь та навичок щодо використання теоретичних і методичних положень з питань організації та управління ризиками у діяльності підприємства, а також вивчення конкретних методів щодо управління та координації процесом управління ризиками

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.

ЗК11. Здатність приймати обґрунтовані рішення.

СК6. Здатність застосовувати економіко-математичні методи та моделі для вирішення економічних задач.

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

Програмні результати навчання

ПР5. Застосовувати аналітичний та методичний інструментарій для обґрунтування пропозицій та прийняття управлінських рішень різними економічними агентами (індивідуумами, домогосподарствами, підприємствами та органами державної влади).

ПР8. Застосовувати відповідні економіко-математичні методи та моделі для вирішення економічних задач.

ПР10. Проводити аналіз функціонування та розвитку суб'єктів господарювання, визначати функціональні сфери, розраховувати відповідні показники які характеризують результативність їх діяльності.

ПР22. Демонструвати гнучкість та адаптивність у нових ситуаціях, у роботі із новими об'єктами, та у невизначених умовах

3. Структура курсу

№	Тема	Результати навчання	Завдання
1.	Тема 1. ОСНОВНІ ЗАСАДИ ЯКІСНОГО АНАЛІЗУ РИЗИКУ	Гносеологічні аспекти економічного ризику Аналіз чинників невизначеності, конфліктності та породжуваного ними економічного ризику Класифікація ризику	Тести, питання, кейси
2.	Тема 2. КІЛЬКІСНИЙ АНАЛІЗ РИЗИКУ	Статистична та нестатистична (суб'єктивна) ймовірність Метод аналогій Аналіз чутливості (вразливості) Аналіз ризику збитків Наслідки кількісного аналізу ризику	Тести, питання, практичні завдання, кейси
3.	Тема 3. СИСТЕМА КІЛЬКІСНИХ ОЦІНОК СТУПЕНЯ РИЗИКУ	Загальні підходи до кількісної оцінки ступеня ризику Ймовірність як один з підходів до оцінки ризику Інгредієнт економічного показника Ризик в абсолютному вираженні Ризик у відносному вираженні Використання нерівності Чебишева	Тести, питання, практичні завдання, кейси
4.	Тема 4. РИЗИК ТА ЕЛЕМЕНТИ ТЕОРІЇ КОРИСНОСТІ	Концепція корисності. Пріоритети та їх числове відображення Корисність за Нейманом Різне ставлення до ризику та корисність Криві байдужості Функція корисності з інтервальною нейтральністю до ризику	Тести, питання, практичні завдання, кейси
5.	Тема 5. УПРАВЛІННЯ РИЗИКОМ	Основні підходи щодо управління ризиком Інваріантні способи зниження ступеня ризику. Зовнішні способи зниження ступеня ризику. Внутрішні способи зниження ступеня ризику Таблиця рішень	Тести, питання, практичні завдання, кейси
6.	Тема 6. ЗАПАСИ, РЕЗЕРВИ ЯК СПОСІБ ЗНИЖЕННЯ СТУПЕНЯ РИЗИКУ	Структура та види резервів і запасів на непередбачувані витрати Резервування грошових засобів на покриття випадкових затрат 129 Управління запасами з урахуванням ризику Задачі управління виробництвом та резервами	Тести, питання, практичні завдання, кейси
7.	Тема 7. ДИВЕРСИФІКАЦІЯ ЯК СПОСІБ ЗНИЖЕННЯ РИЗИКУ: ЕЛЕМЕНТИ ТЕОРІЇ ПОРТФЕЛЯ	Суть диверсифікації Суть управління портфелем цінних паперів Ризик портфеля цінних паперів Норма прибутку цінних паперів Ризик цінних паперів в абсолютному вираженні Ризик цінних паперів у відносному вираженні Кореляція цінних паперів та її застосування Портфель цінних паперів Тактика фінансового менеджера	Тести, питання, практичні завдання, кейси

		Про ефективність роботи фінансового менеджера та аналітика	
8.	Тема 8. МОДЕЛЮВАННЯ ЕКОНОМІЧНОГО РИЗИКУ	Теоретико-ігрова модель Інформаційна ситуація Прийняття рішень в умовах ризику Критерії прийняття рішень	Тести, питання, практичні завдання, кейси
9.	Тема 9. ІЄРАРХІЧНІ МОДЕЛІ ПРИЙНЯТТЯ РІШЕНЬ	Загальна ієрархічна модель Побудова моделі багатоцільової та багатокритеріальної задачі Приклад ситуації прийняття багатоцільового та багатокритеріального рішення Одноцільова багатокритеріальна задача прийняття рішень в полі однієї інформаційної ситуації Одноцільова багатокритеріальна задача прийняття рішень в полі кількох інформаційних ситуацій Багатоцільова та багатокритеріальна задача прийняття рішень в полі кількох інформаційних ситуацій	Тести, питання, практичні завдання, кейси

4. Система оцінювання курсу

Накопичування балів під час вивчення дисципліни	
Види навчальної роботи	Максимальна кількість балів
Лекція	15
Практичне заняття	15
Самостійна робота	10
Індивідуальне завдання	10
Залік	50
Максимальна кількість балів	100

5. Оцінювання відповідно до графіку навчального процесу

Види навчальної роботи	Номер навчального заняття (залежить від розподілу у розділі I)																	Разом
	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	
Лекції	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	2				15
Практичні з-тя	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	2	1				15
Самостійна р-та															10			10
Індивідуальні завдання																10		10
Залік																	50	50
Всього за заняття	2	2	2	2	2	2	2	2	2	2	2	2	3	3	10	10	50	100

Примітка: не рекомендується на один тиждень планувати кілька форм контролю.

6. Ресурсне забезпечення

Матеріально-технічне забезпечення	Мультимедіа, комп'ютери, Linux, Windows, Пакет прикладних програм Openoffice, MS Office, роздатковий матеріал
Література:	
1. Вітлінський В. В. Ризикологія в економіці та підприємстві / В. В. Вітлінський, Г. І. Великоіваненко. – Київ : КНЕУ, 2021. – 480 с.	
2. Гранатуров В. М. Ризики підприємницької діяльності: проблеми аналізу / В. М. Гранатуров, О. Б. Шевчук. – Київ : Зв'язок, 2020. – 150 с.	
3. Клименко С. М. Обґрунтування господарських рішень та оцінка ризиків : навч. посіб. / С. М. Клименко, О. С. Дуброва. – Київ : КНЕУ, 2022. – 252 с.	
4. Концептуальні засади управління підприємством як економічною системою : монографія / В. О. Коюда, Т. І. Лепейко, С. К. Потьомкін та ін. ; за заг. ред. В. О. Коюди. – Харків : Вид. ХНЕУ, 2017. – 416 с.	
5. Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків : навч. посіб. / Т. С. Клебанова, О. В. Мілов, С. В. Мілевський та ін. – Харків : Вид. ХНЕУ, 2019. – 262 с.	
6. Пономаренко В. С. Прийняття управлінських рішень на підприємстві: процесний підхід : наукове видання / В. С. Пономаренко. – Харків : Вид. ХНЕУ, 2019. – 238 с.	
7. Андрійчук В. Г. Менеджмент прийняття рішень і ризик : навч. посіб. / В. Г. Андрійчук, Л. Бауер. – Київ : КНЕУ, 2020. – 304 с.	
8. Внукова Н. М. Економічна оцінка ризику діяльності підприємств : проблеми теорії та практики / Н. М. Внукова. – Харків : ВД "ІНЖЕК", 2016. – 180 с.	
9. Мороз О. В. Оптимальне управління економічними системами в умовах невизначеності та ризику / О. В. Мороз. – Вінниця : Універсум-Вінниця, 2023. – 177 с	

7. Контактна інформація

Кафедра	Економічної кібернетики, вул. Шевченка, 57, 815 кабінет, https://kek.pnu.edu.ua/ , kek@pnu.edu.ua
Викладач	Буртняк Іван Володимирович
Контактна інформація викладача	ivan.burtnyak@pnu.edu.ua

8. Політика навчальної дисципліни

Академічна доброчесність	Дотримання академічної доброчесності засновується на ряді положень та принципів академічної доброчесності, що регламентують діяльність здобувачів вищої освіти та викладачів університету: 1. Кодекс честі Прикарпатського національного університету імені Василя Стефаника. 2. Положення про Комісію з питань етики та академічної доброчесності
--------------------------	--

	<p>Прикарпатського національного університету імені Василя Стефаника.</p> <p>3. Положення про запобігання академічному плагіату та інших видів академічної нечесності у навчальній та науково-дослідній роботі здобувачів освіти Прикарпатського національного університету імені Василя Стефаника.</p> <p>4. Положення про запобігання академічному плагіату у Прикарпатського національного університету імені Василя Стефаника.</p> <p>5. Склад комісії з питань етики та академічної доброчесності Прикарпатського національного університету імені Василя Стефаника.</p> <p>6. Лист МОН України «До питання уникнення проблем і помилок у практиках забезпечення академічної доброчесності». Ознайомитися з даними положеннями та документами можна за посиланням: https://pnu.edu.ua/положення-про-запобігання-плагіату/</p>
<p>Пропуски занять (відпрацювання)</p>	<p>Можливість і порядок відпрацювання пропущених здобувачем освіти занять регламентується «Положення про порядок організації та проведення оцінювання успішності здобувачів освіти ДВНЗ «Прикарпатського національного університету ім. Василя Стефаника» (введено в дію наказом ректора №799 від 26.11.2019) (див. ст. 4). Ознайомитися з положенням можна за посиланням: https://nmv.pnu.edu.ua/нормативні-документи/polozhenja/</p>
<p>Виконання завдання пізніше встановленого терміну</p>	<p>У разі виконання завдання здобувачем освіти пізніше встановленого терміну, без попереднього узгодження ситуації з викладачем, оцінка за завдання – «незадовільно», відповідно до «Положення про порядок організації та проведення оцінювання успішності студентів ДВНЗ «Прикарпатського</p>

	<p>національного університету ім. Василя Стефаника» (введено в дію наказом ректора №799 від 26.11.2019) (див. ст. 4-5). Ознайомитися із положенням можна за посиланням: https://nmv.pnu.edu.ua/нормативні-документи/polozhenja/</p>
<p>Невідповідна поведінка під час заняття</p>	<p>Невідповідна поведінка під час заняття регламентується рядом положень про академічну доброчесність (див. вище) та може призвести до відрахування здобувача вищої освіти (студента) «за порушення навчальної дисципліни і правил внутрішнього розпорядку вищого закладу освіти», відповідно до п.14 «Відрахування студентів» «Положення про порядок переведення, відрахування та поновлення студентів вищих закладів освіти». Ознайомитися із положенням можна за посиланням: https://nmv.pnu.edu.ua/нормативні-документи/polozhenja/</p>
<p>Додаткові бали</p>	<p>Отримання додаткових балів за дисципліною можливе в разі виконання індивідуальних завдань, попередньо узгоджених з викладачем. Перелік індивідуальних завдань міститься у навчальній програмі до курсу. Також за рішенням кафедри управління та бізнес-адміністрування студентам, які брали участь у науково-дослідній роботі (роботі конференцій, студентських наукових гуртків та проблемних груп, підготовці публікацій), а також були учасниками олімпіад, конкурсів, можуть присуджуватися додаткові бали «Положення про порядок організації та проведення оцінювання успішності студентів ДВНЗ “Прикарпатського національного університету ім. Василя Стефаника ” (введено в дію наказом ректора №799 від 26.11.2019)</p>
<p>Неформальна освіта</p>	<p>Можливість зарахування результатів неформальної освіти регламентується</p>

	<p>«Положенням про порядок зарахування результатів неформальної освіти у ДВНЗ «Прикарпатський національний університет імені Василя Стефаника» (введено в дію наказом ректора №819 від 29.11.2019) Ознайомитися із положенням можна за посиланням: https://nmv.pnu.edu.ua/нормативні-документи/polozhenja</p>
--	--

Викладач _____ Іван БУРТНЯК