

СИЛАБУС

навчальної дисципліни «УПРАВЛІННЯ РИЗИКОМ В РЕАЛЬНОМУ СЕКТОРІ ЕКОНОМІКИ»

Спеціальність	051 Економіка
Освітня програма	Цифрова економіка
Рівень вищої освіти	другий (магістерський)
Статус навчальної дисципліни	вбіркова
Код навчальної дисципліни відповідно до освітньо-професійної програми	BK2
Курс / семестр вивчення	10-й семестр
Кількість кредитів ЄКТС / годин	5/150
Розподіл за видами занять та годинами навчання	Лекції - 32 год.
	Практичні - 16 год.
	Самостійна робота - 102 год.
Види індивідуального завдання	реферат
Форма підсумкового контролю	екзамен
Кафедра (назва, № кабінету, контактний телефон, e-mail)	Кафедра економіки, обліку і оподаткування kaf-oblik@suem.edu.ua
Викладач /і:	
Контактна інформація викладача/ів:	
Дні занять	Згідно з розкладом
Консультації	Очні консультації: згідно з графіком Дистанційні: електронна пошта, групи у Вайбері, Телеграмі

Анотація навчальної дисципліни:

Освітня компонента «Управління ризиком в реальному секторі економіки» тісно пов'язана з тематикою наукових досліджень кафедри і передбачає ознайомлення із сучасними методами побудови, дослідження та програмної реалізації чисельних методів обґрунтування рішення в умовах невизначеності та ризику. Значна увага приділяється вирішенню задач стохастичного програмування, рейтингового оцінювання, імітаційного моделювання.

Завдання вивчення освітньої компоненти: формування наукового світогляду, цілісного уявлення, поглиблення та систематизація знань щодо аналізу, оцінювання, моделювання ризиків у реальному секторі економіки та набуття навичок практичного застосування (з використанням ІТ) конкретних методів і моделей для вибору кращих, у певному сенсі, альтернатив і пошуку ефективних управлінських рішень у прикладних проблемах економіки та бізнесу.

Мета навчальної дисципліни:
Навчити майбутніх фахівців з цифрової економіки використанню економіко-математичних методів при прийнятті рішень в умовах невизначеності і породженого нею ризику, характерних для ринкової економіки та оволодіти теоретичними навичками з подальшим застосуванням останніх у прикладних проблемах економіки та бізнесу.
Мета орієнтована на формування у здобувачів таких компетентностей:
<p>ЗК2. Здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу.</p> <p>ЗК3. Здатність мотивувати людей та рухатися до спільної мети.</p> <p>СК5. Здатність визначати ключові тренди соціально-економічного та людського розвитку.</p> <p>СК6. Здатність формулювати професійні задачі в сфері економіки та розв'язувати їх, обираючи належні напрями і відповідні методи для їх розв'язання, беручи до уваги наявні ресурси.</p> <p>СК14. Здатність до побудови моделей прийняття управлінських рішень для вирішення проблем діджиталізації економіки.</p>
Програмні результати навчання:
<p>ПРН7. Обирати ефективні методи управління економічною діяльністю, обґрунтовувати пропонувані рішення на основі релевантних даних та наукових і прикладних досліджень.</p> <p>ПРН8. Збирати, обробляти та аналізувати статистичні дані, науково-аналітичні матеріали, необхідні для вирішення комплексних економічних завдань.</p> <p>ПРН19. Обґрунтувати та управляти проектами або комплексними діями, управлінські рішення щодо ефективного розвитку суб'єктів господарювання.</p>
Очікувані результати, досягнення яких забезпечує навчальна дисципліна:
<p>Знати теоретичні положення економіко-математичних методів та моделей аналізу і управління ризиками в економічній та фінансовій діяльності.</p> <p>Набути практичних навичок у використанні економіко-математичних методів аналізу ризиків та їх комп'ютерної реалізації для вирішення завдань управління.</p> <p>Вміти інтерпретувати отримані аналітичні та математичні результати для прогнозу можливих ризиків, пояснення економічних ефектів та управління економічними системами.</p>
Зміст навчальної дисципліни:
<p style="text-align: center;">Тема 1. Теоретичні засади та загальні положення курсу</p> <p>Підприємницькі ризики ризики: джерела і сутність. Показники ризику і способи його зниження. Система кількісних оцінок економічного ризику. Ризик і теорія ігор. Експертні оцінки виміру ризику. Страхування кредитних ризиків та депозитів. Структура інвестиційних ризиків. Системи оцінок та методи обмеження ризиків іноземних інвестицій.</p> <p style="text-align: center;">Тема 2. Система кількісних оцінок економічного ризику</p> <p>Загальні підходи до кількісного оцінювання ступеня ризику. Ймовірність як один з підходів до оцінки ризику. Інґредієнт економічного показника. Ризик в абсолютному вираженні. Ризик як величина очікуваної невдачі. Ризик як модальне значення міри невдачі. Ризик як міра мінливості результату. Ризик у відносному вираженні. Використання нерівності Чебишева. Уникнення банкрутства при отриманні кредиту. Уникнення банкрутства при наданні кредиту. Визначення меж зон допустимого,</p>

критичного та катастрофічного ризиків. Оцінка ризику ліквідності. Коефіцієнт чутливості бета.

Тема 3. Моделювання економічного ризику на базі концепції теорії гри

Теоретико-ігрова модель та її основні компоненти. Класифікація інформаційних ситуацій. Теорія прийняття рішень. Критерії прийняття рішень при заданому розподілі ймовірностей. Критерій прийняття рішень, коли невідомий розподіл ймовірностей. Критерій прийняття рішень у ситуації, що характеризується антагоністичними інтересами середовища. Критерій Вальда. Критерій домінуючого результату. Критерій мінімального ризику Севіджа. Шоста інформаційна ситуація. Критерій Гурвіца. Модифіковані критерії. Критерій Ходжеса-Лемана. Критерій Парето.

Тема 4. Управління економічними ризиками

Сутність і зміст управління ризиком. Формування стратегії управління ризиком. Можливі три варіанти оцінки доцільності ризику. Система управління ризиком. Принципи управління ризиком. Визначення границь ризику. Принципи управління ризиком. Загальна схема процесу управління ризиком. Програма управління ризиками на підприємстві. Принципи управління ризиками і стратегія підприємства. Вплив стратегії підприємства по управлінню ризиками на вибір процедур управління ними.

Тема 5. Основні способи та методи зниження ризику

Засоби впливу на ризик. Реалізація прийомів зниження ступеня ризику. Профілактика ризиків, як спосіб зниження ризику на підприємстві. Напрямки диверсифікації ризиків, що можуть бути використані на підприємстві. Організаційні методи зниження ступеня ризику. Хеджування в стратегії керування ризиком. Економічні методи зниження ризику. Комбінація методів зниження ступеня ризику на основі таблиць рішень.

Тема 6. Особливості управління економічними ризиками в сфері зовнішньоекономічної діяльності

Основні види ризиків у зовнішньоекономічній діяльності. Ризики, пов'язані з вибором країни для здійснення зовнішньоекономічних операцій. Ризики, пов'язані з вибором іноземного партнера. Маркетингові ризики. Транспортні ризики. Ризики, пов'язані з укладанням МГК. Комерційні ризики в ЗЕД. Ризики, пов'язані з митним регулюванням. Причини виникнення ризиків зовнішньоекономічної діяльності. Класифікація ризиків у зовнішньоекономічній діяльності. Методи управління ризиками ЗЕД.

Рекомендована література:

1. Управління ризиками: навчальний наочний посібник / М. О. Кравченко, К. О. Бояринова, К. О. Копішинська ; КПІ ім. Ігоря Сікорського. Київ : КПІ ім. Ігоря Сікорського, 2021. 432 с. URL: <https://ela.kpi.ua/handle/123456789/43528>.
2. Економічні ризики: методи вимірювання та управління : навчальний посібник / Н. С. Скопенко, І. В. Федулова, Л. В. Мазник, О. М. Кириченко, Л. І. Удворгелі ; за заг. ред. Н. С. Скопенко. Київ : Видавничий дім «Кондор», 2021. 348 с. URL: <https://dspace.nuft.edu.ua/jspui/handle/123456789/39065>.
3. Конспект лекцій з дисципліни “Моделювання ризиків в економіці та бізнесі” для студентів спеціальності 8.03050201 та 7. 03050201 “Економічна кібернетика” всіх форм навчання / Укл. С. В. Гринчуцька – Тернопіль, ТНТУ імені І. Пулюя, 2014. 88с. URL: <http://elartu.tntu.edu.ua/bitstream/lib/22559/5/2014-ModRyz-KonspLekc.pdf>.

Методи викладання, навчання:

Проблемні лекції.
Семінарські заняття: публічне обговорення питань тем курсу, навчальні дискусії.
Виконання індивідуального навчально-дослідні завдання (ІНДЗ): інформативний

реферат, електронна презентація на обрану тему наукової доповіді.

Форми контролю успішності навчання:

Контрольні заходи з перевірки успішності засвоєння навчального матеріалу з дисципліни включають: поточний контроль, виконання індивідуальних навчально-дослідних занять (ІНДЗ), підсумковий контроль.

Поточний контроль має на меті перевірку виконання завдань як аудиторної, так і самостійної роботи студентів та може проводитися в таких формах:

- перевірка підготовлених виступів, доповідей з тематики семінарських занять;
- усне опитування або письмовий експрес-контроль на аудиторних заняттях;
- перевірка виконання завдань СРС.

Контроль виконання ІНДЗ здійснюється у формі перевірки і захисту виконання інформативного реферату, наукової доповіді на обрану тему з електронною презентацією.

Формою підсумкового контролю з навчальної дисципліни «Управління ризиком в реальному секторі економіки» є екзамен.

Семестровий екзамен – вид підсумкового контролю засвоєння студентами теоретичного та практичного матеріалу з навчальної дисципліни за семестр, що проводиться в період екзаменаційної сесії.

Форма проведення семестрового екзамену – електронне тестування. При проведенні підсумкового контролю у формі електронного тестування використовується набір тестових завдань, які містяться в бібліотеці електронних курсів системи дистанційного навчання СУРА для перевірки знань студентів.

Система оцінювання результатів навчання:

Згідно з діючою в університеті системою комплексної діагностики знань студентів, з метою стимулювання планомірної та систематичної навчальної роботи, оцінка знань студентів здійснюється за 100-бальною системою.

Підсумковий бал з навчальної дисципліни є сумою балів, одержаних за поточний, підсумковий контроль (екзамен) та виконання індивідуального завдання.

Схема розподілу балів:

50 балів (поточний контроль)	10 балів (контроль виконання індивідуального завдання)	40 балів (підсумковий контроль - екзамен)
---------------------------------	---	---

Мінімальний пороговий рівень з кожного виду контролю:

30 балів (поточний контроль)	5 балів (контроль виконання індивідуального завдання)	25 балів (підсумковий контроль - екзамен)
---------------------------------	--	---

Накопичування балів з навчальної дисципліни під час поточного контролю відбувається під час оцінювання таких видів робіт:

- 1) Доповіді, виступи, участь в дискусіях і обговоренні на семінарських заняттях;
- 2) Усне опитування;
- 3) Письмові роботи з засвоєння тем курсу;
- 4) Виконання завдань СРС.

Кожний вид поточної навчальної роботи студента оцінюється за 5-бальною шкалою.

Загальна семестрова оцінка за 100-бальною шкалою переводиться у національну шкалу відповідно до таблиці:

Сума балів за всі види навчальної діяльності	Шкала ЄКТС	Оцінка за національною шкалою	
		для екзамену, курсової роботи)	для заліку
90-100	A	відмінно	зараховано
82-89	B	добре	
74-81	C		
64-73	D	задовільно	
60-63	E		
35-59	FX	незадовільно з можливістю повторного складання	не зараховано з можливістю повторного складання
1-34	F	незадовільно з обов'язковим повторним вивченням дисципліни	не зараховано з обов'язковим повторним вивченням дисципліни

Критерії і порядок оцінювання навчальних досягнень здобувачів під час усіх видів контролю здійснюється відповідно до затверджено в університеті «Положення про критерії та порядок оцінювання навчальних досягнень з навчальних дисциплін здобувачів вищої освіти» (URL : <https://www.suem.edu.ua/normatyvni-dokumeny>).

Політика курсу:

Політика дотримання академічної доброчесності

Викладання навчальної дисципліни ґрунтується на засадах академічної доброчесності. Порушеннями академічної доброчесності вважаються: академічний плагіат, фабрикація, фальсифікація, списування.

За порушення академічної доброчесності студенти можуть бути притягнені до такої академічної відповідальності: повторне проходження оцінювання (контрольна робота, іспит тощо); повторне проходження відповідного освітнього компонента освітньої програми.

Комунікаційна політика

Студенти повинні мати активовану університетську пошту.

Обов'язком студента є перегляд новин на Телеграм-каналі.

Протягом тижнів самостійної роботи обов'язком студента є робота з дистанційним курсом «Правові засади розвитку інформаційного суспільства в Україні».

Політика щодо пропусків занять

Студенти мають відвідувати лекційні й семінарські заняття. Відсутність студента на занятті може бути виправдана поважною причиною. Поважними причинами відсутності вважаються: хвороба, участь у Всеукраїнській студентській олімпіаді, Всеукраїнському конкурсі студентських наукових робіт чи будь-якому іншому заході, який можна віднести до заходів, що сприяють розвитку студентів і поліпшенню іміджу університету (факультету).

Політика щодо виконання навчальних завдань пізніше встановленого терміну

Студенти мають виконувати всі навчальні завдання у встановлені терміни. Студент, який не виконав ту чи іншу кількість навчальних завдань вчасно й хоче надолужити прогаяне, може звернутися по допомогу до викладача.

Політика щодо оскарження оцінювання

Якщо студент не згоден з оцінюванням його знань він може оскаржити виставлену викладачем оцінку у встановленому порядку.

Бонуси

Студенти, які регулярно відвідували лекції (мають не більше двох пропусків без поважних причин) та мають написаний конспект лекцій отримують додатково 2 бали до результатів оцінювання до підсумкової оцінки.

Rauf Ablyazov East European University