

## СИЛАБУС

### навчальної дисципліни «Управління ризиками»

Спеціальність	073 «Менеджмент»
Освітня програма	Бізнес-адміністрування
Рівень вищої освіти	Перший (бакалаврський)
Статус навчальної дисципліни	вибіркова
Код навчальної дисципліни відповідно до освітньо-професійної програми	ВК 9
Семестр вивчення	5-й семестр
Кількість кредитів ЄКТС / годин	5 / 150
Розподіл за видами занять та годинами навчання	Лекції - 32 год. Практичні, семінарські заняття - 16 год. Самостійна робота - 102 год.
Вид індивідуального завдання	Практичні завдання, доповідь
Форма підсумкового контролю	залік
Кафедра (назва, № кабінету, контактний телефон, e-mail)	Кафедра Менеджменту і адміністрування
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

Навчальна дисципліна орієнтована на теоретичну та практичну підготовку студентів щодо розуміння сутності, методології і методики управління ризиками в частині: виявлення «слабких» місць в господарській діяльності; ідентифікації ризиків у менеджменті; формування стратегії переходу від ситуації невизначеності до ситуації ризику; засвоєння основних способів та методів оцінки й оптимізації ризику та основ стратегії ризик-менеджменту.

#### Мета навчальної дисципліни:

Формування у студентів знань щодо методології управління ризиками та оволодіння практичним інструментарієм застосування прийомів і методів їх ідентифікації та оптимізації.

#### Мета орієнтована на формування у студентів таких компетентностей:

ЗК4. Здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях

ЗК17. Уміння критично оцінити пропоновані варіанти управлінських рішень і розробити та обґрунтувати пропозиції щодо їх вдосконалення з урахуванням критеріїв соціально-економічної ефективності, ризиків і можливих соціально-економічних наслідків.

#### Програмні результати навчання (відповідно до освітньо-професійної програми)

ПРН 4. Демонструвати навички виявлення проблеми та обґрунтування управлінських рішень.

- ПРН 8. Застосовувати методи менеджменту для забезпечення ефективності діяльності організації
- ПРН 14. Ідентифікувати причини стресу, адаптувати себе та членів команди до стресової ситуації, знаходити засоби до її нейтралізації
- ПРН 18. Демонструвати навички стратегічного та інноваційного управління в умовах невизначеності та ризику; ідентифікувати ризики
- ПРН 20. Демонструвати навички аналізу результативності функціонування системи управління підприємства, обґрунтування напрямів його перспективного розвитку з урахуванням галузевих особливостей

### **Очікувані результати навчання**

- Ідентифікувати класифікацію і види ризиків;
- Визначати місце ризику в інвестуванні капіталу, способи оцінки ступеню ризику;
- Засвоїти зміст та організацію механізму управління ризиком;
- Розуміти основні принципи здійснення моделювання та управління ризиками.
- Ідентифікувати ризики у господарській діяльності;
- Аналізувати та класифікувати ризики притаманні тому чи іншому виду діяльності;
- Проводити оцінку ризиків;
- Розробляти стратегії ризик-менеджменту для мінімізації впливу ризиків на господарську діяльність підприємств.

### **Зміст навчальної дисципліни:**

#### **Змістовий модуль 1**

##### ***Тема 1. Ризик в підприємстві.***

Поняття невизначеності і ризику. Графічна інтерпретація ризикованого та безризикового проєктів.

Фактори невизначеності і ризику. Групи причин виникнення невизначеності і спричиненого нею ризику. Фактори, що визначають ступінь ризику.

Передумови виникнення ризику. Основні риси ризику.

##### ***Тема 2. Функції, мета та задачі управління ризиком.***

Функції ризику (інноваційна, регулятивна, захисна, аналітична, сануюча функції).

Можливі причини виникнення ризиків (від джерела виникнення, від можливості запобігання, по вірогідності настання, по об'єкту посягання, за природою їх виникнення, залежно від величини втрат або збитку, за ступенем вірогідності)

Ризик-менеджмент як галузь наукового управління (як явище, як процес, як система, як мистецтво, як наука).

Мета і задачі ризик-менеджменту. Історія виникнення науки управління ризиком.

##### ***Тема 3. Класифікація ризиків.***

Основні підходи до класифікації ризиків. Катастрофічний, критичний, допустимий ризики. Класифікація ризиків за ступенем правомірності, залежно від можливого економічного результату, залежно від причини виникнення, залежно від купівельної спроможності грошей.

Зовнішні ризики. Класифікація зовнішніх ризиків.

Внутрішні ризики. Класифікація внутрішніх ризиків.

Загальна класифікація ризиків. Класифікація комерційних ризиків.

##### ***Тема 4. Аксіоми, закони і принципи ризик-менеджменту.***

Основні аксіоми ризик-менеджменту.

Закони управління ризиками. Загальні, часткові, спеціальні закони ризик-менеджменту.

Принципи ризик-менеджменту. Механізм формування принципів управління.

### ***Тема 5. Процесний підхід до вивчення ризик-менеджменту.***

Поняття і суть процесного підходу. Технологія управління. Функціональний розподіл управлінської праці.

Зовнішній і внутрішній моніторинг ризиків. Структура зовнішнього середовища організації.

Планування в системі ризик-менеджменту. Організаційна функція ризик-менеджменту. Мотивація як функція ризик-менеджменту. Регулювання. Облік і контроль в системі управління ризиками.

Оцінка ефективності управління ризиками

## **Змістовий модуль 2.**

### ***Тема 6. Методологія ризик-менеджменту.***

Поняття і види методів управління ризиками. Класифікація методів залежно від масштабів використання, за галузями і сферами використання.

Юридичні методи управління ризиками. Адміністративні методи ризик-менеджменту. Суть економічних методів управління ризиками. Поняття і зміст соціальних методів управління. Особливості вживання психологічних методів управління ризиками.

Виробничі методи ризик-менеджменту. Використання науково-прикладних методів управління в системі ризик-менеджменту.

*Література* [1, 4, 7, 9-11, 13, 14-17].

### ***Тема 7. Ухвалення управлінських рішень в умовах ризику і невизначеності.***

Поняття і суть управлінських рішень.

Процедура підготовки, ухвалення і реалізації управлінських рішень. Цикл розробки, ухвалення і реалізації управлінських рішень. Зони ризику і ситуації невизначеності.

Методи розробки і ухвалення управлінських рішень в системі ризик-менеджменту. Методи моделювання і методи експертних оцінок.

### ***Тема 8. Стратегія, політика і тактика ризик-менеджменту.***

Стратегія управління ризиками. Основна мета стратегії ризик-менеджменту. Задачі стратегічного ризик-менеджменту.

Основні форми політики ризик-менеджменту. Структурна політика фірми.

Тактичне управління ризиками

### ***Тема 9. Зовнішні підприємницькі ризики і методи управління ними.***

Поняття, суть і види зовнішніх ризиків. Політичні ризики. Основні групи політичних ризиків (ризик націоналізації і експропріації без адекватної компенсації; ризик трансферту, пов'язаний з можливими обмеженнями на конвертацію місцевої валюти; ризик розриву контракту через дії властей країни, в якій знаходиться компанія-контрагент; ризик військових дій і цивільного безладдя).

Особливості управління комерційними ризиками. Основні причини комерційного ризику (зниження обсягів реалізації в результаті падіння попиту або потреби на товар, реалізований підприємницькою фірмою, витіснення його конкуруючими товарами, введення обмежень на продаж; підвищення закупівельної ціни товару в процесі здійснення підприємницького проекту; непередбачене зниження обсягів закупівель порівняно з наміченими, що зменшує масштаб всієї операції і збільшує витрати на одиницю обсягу реалізованого товару (за рахунок умовно постійних витрат); втрати товару, або зниження якості товару в процесі обігу, що приводить до зниження його ціни; підвищення витрат обігу порівняно з наміченими в результаті виплати штрафів, непередбачених мит і відрахувань, що приводить до зниження прибутку підприємницької фірми).

Фінансові ризики. Основні види інвестиційних ризиків. Загальна характеристика галузевих і структурних ризиків. Інноваційні ризики. Управління екологічними ризиками.

Логістичні ризики.

**Тема 10. Особливості управління внутрішніми адміністративними ризиками.**

Управлінські дисфункції як причина виникнення внутрішніх ризиків. Основні причини виникнення управлінських дисфункцій. Основні види адміністративних ризиків.

Управління технічними і виробничими ризиками. Основні причини технічних і виробничих ризиків.

Особливості управління соціальними ризиками. Психологічні ризики.

**Методи викладання, навчання:**

Проблемні лекції.

Практичні заняття: публічне обговорення питань тем курсу, виконання практичних завдань, експрес-опитування.

Виконання індивідуальних навчально-дослідних завдань (ІНДЗ): практичні завдання, 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 завдань (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 лекційних занять;
- усне опитування або письмовий експрес-контроль на аудиторних заняттях;
- перевірка виконання завдань СРС.

Контроль виконання *ІНДЗ* здійснюється у формі перевірки практичних завдань, наукової доповіді на обрану тему з електронною презентацією.

Формою *підсумкового контролю* з навчальної дисципліни є *залік*.

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

Форма проведення семестрового заліку – 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.

**Рекомендована література:**

1. Вітлінський В. В., Наконечний С. І., Шарапов О. Д. Економічний ризик та методи його вимірювання: Підручник. К.: КНЕУ, 2000. 354 с
2. Івченко І.Ю. Економічні ризики: навч.посіб. К.: Центр навчальної літератури, 2004. 304с.
3. Ілляшенко С.М. Економічний ризик: навч.посіб. 2-ге вид., доп. і перероб. К.: Центр навчальної літератури, 2004. 220с.
4. Камінський А. Б. Економічний ризик та методи його вимірювання: навч. посіб. : Вид. дім «Козаки», 2002. – 120 с.
5. Старостіна А.О., Кравченко В.А. Ризик-менеджмент: теорія та практика: навч. посіб. К.: ІВЦ “Видавництво «Політехніка», 2004. 200 с.

**Електронні ресурси:**

6. Економічний ризик: методи оцінки та управління : навч. посіб. / [Т. А. Васильєва, С. В. Леонов, Я. М. Кривич та ін. ] ; під заг. ред. д-ра екон. наук, проф. Т. А. Васильєвої, канд. екон. наук Я. М. Кривич. Суми : ДВНЗ «УАБС НБУ», 2015. 208 с. URL: [https://essuir.sumdu.edu.ua/bitstream-download/123456789/50229/5/Ekonomichnyi\\_ryzyk%20.pdf](https://essuir.sumdu.edu.ua/bitstream-download/123456789/50229/5/Ekonomichnyi_ryzyk%20.pdf)
7. Мороз В.М., Мороз С.А. Ризик-менеджмент : навч. посібник для студ. спец. 281

«Публічне управління та адміністрування». Харків : НТУ «ХП», 2018. 140 с. URL: [http://repository.kpi.kharkov.ua/bitstream/KhPI-Press/39143/1/Book\\_2018\\_Moroz\\_Ryzyk\\_menedzhment.pdf](http://repository.kpi.kharkov.ua/bitstream/KhPI-Press/39143/1/Book_2018_Moroz_Ryzyk_menedzhment.pdf)

8. Управління фінансовими ризиками: навч. посіб. / Куцик П.О. та ін. Львів : Растр-7, 2016. 318 с. URL: [http://www.lute.lviv.ua/fileadmin/www.lac.lviv.ua/data/kafedry/Buh\\_Obliku/Kucik/Docs/Kusy\\_k\\_Upravlinnia\\_fin\\_ryzykamy.pdf](http://www.lute.lviv.ua/fileadmin/www.lac.lviv.ua/data/kafedry/Buh_Obliku/Kucik/Docs/Kusy_k_Upravlinnia_fin_ryzykamy.pdf).

### 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.

Підсумкова оцінка (залік) виставляється на підставі суми накопичених балів студентом, отриманих у ході поточного контролю, виконання індивідуального завдання.

### Схема розподілу балів:

70 балів (поточний контроль)	30 балів (контроль виконання індивідуального завдання)
---------------------------------	---

### Мінімальний пороговий рівень з кожного виду контролю:

45 балів (поточний контроль)	15 балів (контроль виконання індивідуального завдання)
---------------------------------	---

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

- 1) участь у дискусіях, доповіді (презентації), виступи на практичних заняттях;
- 2) виконання практичних індивідуальних завдань;
- 3) усне опитування;
- 4) електронне тестування;
- 5) виконання завдань самостійної роботи.

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, курсового проекту (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 «Управління ризиками».

### ***Політика щодо пропусків занять***

Студенти мають відвідувати лекційні й практичні 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.