



УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ (ПО 11)

Робоча програма навчальної дисципліни (Силабус)

Реквізити навчальної дисципліни

Рівень вищої освіти	Перший (бакалаврський)
Галузь знань	07 – Управління та адміністрування
Спеціальність	073 – Менеджмент
Освітня програма	Менеджмент і бізнес-адміністрування
Статус дисципліни	Обов'язкова дисципліна циклу професійної підготовки
Форма навчання	Денна / заочна /
Рік підготовки, семестр	IV курс, сьомий семестр
Обсяг дисципліни	3,5 кредити (105 годин)
Семестровий контроль / контрольні заходи	Екзамен / контроль роботи на практичних заняттях, виконання навчальних завдань, проходження тестування, виконання модульної контрольної роботи
Розклад занять	за розкладом: http://rozklad.kpi.ua
Мова викладання	Українська
Інформація про викладачів	Лектор: Копішинська Катерина Олександрівна, к.е.н., доцент кафедри менеджменту, kopishynska@ukr.net Викладачі: Копішинська Катерина Олександрівна - к.е.н., доцент кафедри менеджменту, kopishynska@ukr.net , Кизименко Костянтин Сергійович, - аспірант, викладач кафедри менеджменту, kostia.kizimenko@gmail.com
Розміщення курсу	https://do.ipu.kpi.ua/course/view.php?id=3933

Програма навчальної дисципліни

1. Опис навчальної дисципліни, її мета, предмет вивчення та результати навчання

Курс дисципліни розкриває специфіку прийняття та інструментарій реалізації економічних рішень в умовах невизначеності, спрямованих на зниження ймовірності виникнення несприятливого результату та мінімізацію можливих втрат підприємства від його настання. Логіка побудови курсу передбачає послідовне вивчення теоретичних засад та ознайомлення зі стандартами управління ризиками, опанування методів і інструментарію аналізу, оцінки й мінімізації економічних ризиків, а також визначення прикладних аспектів організації системи управління ризиками на підприємстві.

Метою курсу є опанування знань щодо поняття, природи та закономірностей виникнення економічних ризиків, набуття умінь щодо ідентифікації, оцінювання, моделювання і аналізу ризиків та навичок застосування відповідного інструментарію, та на їх основі формування компетенцій щодо управління

економічними ризиками в діяльності підприємства. Після засвоєння курсу у студентів формуються такі фахові компетентності (ФК) та програмні результати навчання у формі знань (ЗН) та умінь (УМ).

Фахові компетентності:

ФК 2 – здатність аналізувати результати діяльності організації, зіставляти їх з факторами впливу зовнішнього та внутрішнього середовища, зокрема аналізувати ризики та наслідки їх впливу на діяльність підприємства, використовуючи відповідні методи аналізу та оцінки;

ФК 12 – здатність аналізувати й структурувати проблеми організації, формувати обґрунтовані рішення, зокрема здатність ідентифікувати, аналізувати та оцінювати ризики, на основі чого розробляти рішення, щодо нівелювання або мінімізації їх впливу;

ФК 20 – здатність застосовувати інструментарій управління ризиками в різних сферах господарської діяльності підприємства, зокрема здатність застосовувати методи та інструментарій управління ризиками, що включає алгоритми, методи, моделі, інформаційне й програмне забезпечення, їх оцінювання та управління.

Програмні результати навчання:

ЗН 2 – знання теорії, методів і функцій менеджменту, сучасних концепцій лідерства, у тому числі підходів до управління промисловими підприємствами, зокрема основних науково-методичних підходів, що склалися у сфері управління ризиками;

ЗН 3 – знання процедур пошуку, збирання та аналізу інформації, розрахунку показників для обґрунтування управлінських рішень, зокрема процедур ідентифікації ризиків, визначення їх ступеня і міри, розроблення заходів щодо управління ризиками;

ЗН 4 – знання методів менеджменту для забезпечення ефективності діяльності організації, зокрема методів запобігання та мінімізації ризиків підприємства;

ЗН 7 – знання закономірностей функціонування соціально-економічних систем різних рівнів і сфер діяльності, а саме знання організаційно-економічних особливостей формування системи управління ризиками на підприємстві;

ЗН 9 – знання методів і принципів управління підприємствами, зокрема в умовах невизначеності та ризику.

УМ 3 – уміння демонструвати навички виявлення проблемних ланок менеджменту організації та обґрунтування управлінських рішень, спрямованих на їх оптимізацію, зокрема уміння здійснювати добір протиризикових заходів;

УМ 5 – уміння демонструвати навички аналізу ситуації та здійснення комунікації у різних сферах діяльності організації, у тому числі у сфері управління та бізнес-адміністрування різних напрямів діяльності, зокрема аналізу ризикової ситуації та визначення взаємозв'язку загальних функцій управління ризиками зі стадіями розвитку ризикової ситуації;

УМ 11 – уміння виявляти навички організаційного проектування, зокрема враховувати фактори невизначеності та ризику в процесі проектування.

2. Пререквізити та постреквізити дисципліни (місце в структурно-логічній схемі навчання за відповідною освітньою програмою)

Пререквізити:

«Теорія імовірностей та математична статистика для менеджерів», «Економіка та фінанси підприємства», «Планування та прогнозування діяльності підприємства», «Проектний менеджмент», «Економічний аналіз», «Інвестиційний аналіз».

Постреквізити:

Підготовка дипломної роботи бакалавра.

3. Зміст навчальної дисципліни

Тема 1. Ризик як об'єкт управління

Тема 2. Основні концепції ризик-менеджменту підприємств

Тема 3. Методичні засади аналізу ризиків підприємства

Тема 4. Кількісні методи аналізу та оцінки ризиків

Тема 5. Експертні методи аналізу та оцінки ризиків

Тема 6. Застосування теорії ігор для оцінки ризиків

Тема 7. Моделювання та аналіз ризиків інвестиційних проектів

Тема 8. Підходи і методи управління ризиками підприємств

Тема 9. Стандарти організації ризик-менеджменту підприємств

4. Навчальні матеріали та ресурси

4.1. Базова література:

1. Вітлінський В.В., Верченко П.І. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком: Навчально-методичний посібник для самостійного вивчення дисципліни. Київ: КНЕУ, 2000. 292 с.
2. Івченко І.Ю. Моделювання економічних ризиків і ризикових ситуацій: Навчальний посібник. Київ: Центр учбової літератури, 2007. 344 с.
3. Кравченко М.О., Бояринова К.О. Управління ризиками: Методичні вказівки до проведення практичних занять та самостійної роботи студентів. Київ: Кондор, 2014. 84 с.
4. Пікус Р. Управління фінансовими ризиками: навчальний посібник. Київ: Знання. 2011. 598 с.
5. Управління ризиками в інноваційній діяльності: навчальний посібник / Кузьмін О. Є., Подольчак Н. Ю., Подольчак Н. І., Вербицька Л. Г. Львів: Видавництво Львівської політехніки, 2012. 240 с.

4.2. Допоміжна література:

1. Alviuinessen A., Jankensgard H. Enterprise Risk Budgeting: Bringing Risk Management Into the Financial Planning Process. *Journal of Applied Finance*. 2009. No. 19(1/2). Pp. 178-190.
2. Chan N.H., Wong H.Y. Simulation Techniques in Financial Risk Management Statistics in Practice. New York: John Wiley and Sons, 2006, 230 p.
3. COSO ERM: Enterprise Risk Management Integrated Framework. Committee of Sponsoring Organizations of the Treadway Commission. URL: <https://www.dvbi.ru/risk-management/library/Token/ViewInfo/ItemId/5> Стандарт-управлення-рисками-COSO-ERM-eng-rus.
4. Chong Y.Y. Investment Risk Management. Wiley Finance Series. Chichester: John Wiley and Sons, 2004, 210 p.
5. Doherty N.A. Integrated risk management: Techniques and strategies for reducing risk. New York: McGraw-Hill, 2000. 523 p.
6. IEC 31010:2019. Risk management: Risk assessment techniques. International Organization for Standardization. URL: <https://www.iso.org>.
7. ISO 31000:2018. Risk management: Guidelines. International Organization for Standardization. URL: <https://www.iso.org>.
8. ISO 31000:2018. Менеджмент рисков: Принципы и руководящие указания. International Organization for Standardization. URL: <https://www.iso.org>.
9. ISO GUIDE 73:2009. Risk management: Vocabulary. International Organization for Standardization. URL: <https://www.iso.org>.
10. Marchetti A.M. Enterprise Risk Management Best Practices: From Assessment to Ongoing Compliance. Chichester: John Wiley and Sons, 2011, 194 p.
11. Marchetti A.M. Enterprise Risk Management Best Practices: From Assessment to Ongoing Compliance. Chichester: John Wiley and Sons, 2011, 194 p.
12. Savage S.L. The flaw of averages: why we underestimate risk in the face of uncertainty. Chichester: John Wiley and Sons, 2009, 419 p.
13. Vose D., Risk Analysis: a quantitative guide. Chichester: John Wiley and Sons, 2008. 729 p.
14. Гельруд Я.Д. Теория игр: Учебное пособие. Челябинск: ЧГУ, 2012. 64 с.
15. Киселева И.А. Моделирование рискованных ситуаций: Учебно-практическое пособие. Москва: МЭСИ, 2007. 102 с.
16. Королев В.Ю. Бенинг В.Е., Шоргин С.Я. Математические основы теории риска. Москва: Физматлит, 2011. 620 с. URL: <http://znanium.com/catalog/product/309094>
17. Лобанов А.А., Чугунов А.В. Энциклопедия финансового риск-менеджмента. Москва: Альпина Паблишер, 2003. 786 с.
18. Недосекин А.О., Абдулаева З.И. Риски бизнеса: идентификация, анализ, управление: Учебный курс. Санкт-Петербург: Монография, 2010, 126 с. URL: https://www.studmed.ru/nedosekin-ao-abdulaeva-zi-riski-biznesa-identifikaciya-analiz-upravlenie_8d62b1e2fae.html.
19. Риск-менеджмент инвестиционного проекта: Учебник / Под ред. М.В. Грачевой, А.Б. Секерина. Москва: Юнити-Дана, 2009. 544 с.
20. Шапкин А.С., Шапкин В.А. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций. Москва: Дашков и Ко, 2012. 544 с.
21. Шоломицкий А.Г. Теория риска. Выбор при неопределенности и моделирование риска: Учебное пособие. Москва: ГУ ВШЭ, 2005. 400 с.

Навчальний контент

5. Методика опанування навчальної дисципліни (освітнього компонента)

Курс дисципліни складається з трьох тематичних розділів: та передбачає проведення 18 лекційних (Л) та 36 практичних (П) аудиторних занять:

1. Теоретичні засади та стандарти організації ризик-менеджменту підприємств (теми 1-3).
2. Методи аналізу та оцінки ризиків (теми 2-8).
3. Методи управління ризиками підприємств (тема 9).

Розподіл видів навчальних занять, виконуваних робіт та контрольних заходів щодо їх засвоєння за темами курсу та тижнями навчання наведена в таблиці.

6. Самостійна робота студента/аспіранта

Планом передбачено 36 годин самостійної роботи студентів (СРС). Вона охоплює підготовку студентів до аудиторних занять та самостійне виконання розрахункової роботи, навчальних розрахунково-аналітичних завдань, ділових ігор та кейсів. Розподіл самостійної роботи студентів за темами курсу наведено в таблиці.

Тиждень	Тема, що вивчається (нумерація наведена за розділами)	Види занять*			Види робіт**
		Л	П	СРС	
1	1. Ризик як об'єкт управління	2	4	5	П, Н
2	2. Основні концепції ризик-менеджменту підприємств	2	4	5	П, Н
3	3. Методичні засади аналізу ризиків підприємства	2	4	7	П, Н
4	4. Кількісні методи аналізу та оцінки ризиків	2	4	7	П, Н
5	5. Експертні методи аналізу та оцінки ризиків	2	4	7	П, Н
6	6. Застосування теорії ігор для оцінки ризиків	2	4	5	П, Н
7	7. Моделювання та аналіз ризиків інвестиційних проектів	2	4	5	П, Н, МКР
8	8. Підходи і методи управління ризиками підприємств	2	4	5	П, Н
9	9. Стандарти організації ризик-менеджменту підприємств	2	4	5	П, Н,
Разом		18	36	51	

* Л – лекції, П – практичні заняття, СРС – самостійна робота студентів;

** Р – робота на практичних заняттях, Н – виконання навчальних завдань, Т – тестування, МКР – модульна контрольна робота.

Політика та контроль

7. Політика навчальної дисципліни

Ключовими заходами при викладанні дисципліни є ті, які формують семестровий рейтинг студента. Студенти мають своєчасно виконувати завдання відповідно до умов отримання першої та другої атестації, писати модульні контрольні роботи.

Штрафних балів з дисципліни не передбачається.

Студенту можуть бути перезараховані бали, які він отримав за такий або подібний курс, пов'язаний з розробкою та управлінням стартапами, в іншому закладі вищої освіти.

Студентам можуть нараховуватись заохочувальні бали (усього – не більше 5 балів) за такі види наукової та дослідної роботи:

- проведення науково-дослідної роботи за темами, що виносяться на самостійне вивчення, результати якої представлено у вигляді наукових тез, статті, презентації, огляду наукових праць тощо (ваговий бал – 5);
- участь у олімпіадах I та II рівнів, що відповідають тематиці дисципліни (ваговий бал – 5);
- участь у конкурсах наукових робіт, що відповідають тематиці дисципліни (ваговий бал – 5).

Відвідування занять є вільним, бали за присутність на лекція та практичних заняттях не додаються. Втім, вагома частина рейтингу студента формується через активну участь у виконанні навчальних завдань на практичних заняттях, тому у разі їх пропуску студент не матиме можливості отримати відповідні рейтингові бали. Якщо контрольні заходи пропущені з поважних причин (хвороба або інші вагомні життєві обставини), студенту надається додаткова можливість їх складання протягом найближчого тижня. В разі порушення термінів та невиконання умов допуску до підсумкової атестації з неповажних причин, студент не допускається до складання екзамену в основну сесію.

8. Види контролю та рейтингова система оцінювання результатів навчання (PCO)

Рейтингова оцінка студента з курсу дисципліни, проведення підсумкового контролю за якою передбачено у вигляді екзамену, формується як сума балів поточної успішності навчання (стартового рейтингу) та підсумкової атестації (екзаменаційних балів).

8.1. Стартовий рейтинг студента складається з балів, які він отримує за такі види робіт:

- робота на практичних заняттях (П) – передбачає участь у дискусійному обговоренні питань та розв’язанні задач (орієнтовна кількість відповідей студента протягом семестру – 4, ваговий бал – 2);
- виконання навчальних завдань (Н) – передбачає представлення виконаних самостійно та (або) в групах розрахунково-аналітичних завдань, ділових ігор та кейсів (орієнтовна кількість відповідей студента протягом семестру – 5, ваговий бал – 4);
- виконання модульної контрольної роботи (МКР) – передбачає виконання письмові роботи напередодні або під час 1-го атестаційного тижня (кількість робіт – 1, ваговий бал – 16);
- виконання тестових завдань протягом семестру – передбачає відповіді на теоретичні питання курсу у тестовій формі (кількість тестів – 8, ваговий бал – 2).

Максимальний стартовий рейтинг студента – 60 балів.

Умовою позитивної першої атестації є отримання студентом на час атестації не менше 12 балів. Умовою позитивної другої атестації – отримання не менше 28 балів.

Умовою допуску до екзамену є стартовий рейтинг не менше 30 балів.

8.2. Підсумкова атестація проводиться у вигляді письмового екзамену після завершення аудиторного навчання.

Екзаменаційна робота складається з таких завдань:

- розкриття теоретичних питань (кількість питань – 2, ваговий бал – 3);
- виконання тестових завдань (кількість завдань – 10, ваговий бал – 1);
- виконання розрахунково-аналітичних завдань (кількість завдань – 3, ваговий бал – 8).

Максимальна екзаменаційна оцінка – 40 балів.

Максимальна оцінка за курс – 100 балів.

Таблиця відповідності рейтингових балів оцінкам за університетською шкалою:

Кількість балів	Оцінка
100-95	Відмінно
94-85	Дуже добре
84-75	Добре
74-65	Задовільно
64-60	Достатньо
Менше 60	Незадовільно
Не виконані умови допуску	Не допущено

9. Додаткова інформація з дисципліни

На розсуд викладача студентам можуть бути зараховані сертифікати проходження очних, дистанційних або онлайн курсів за відповідною тематикою.

У разі запровадження обмежень на відвідування ЗВО, пов’язаних з введенням карантину, вивчення дисципліни здійснюється у дистанційному або онлайн форматі.

Робочу програму навчальної дисципліни (силабус):

Складено доцентом кафедри менеджменту, к.е.н., Копішинською К. О.

Ухвалено кафедрою менеджменту (протокол №17 від 08.06.2021 р.)

Погоджено Методичною комісією факультету менеджменту та маркетингу (протокол №10 від 15.06.2021р.)