

**Східноєвропейський національний університет імені Лесі Українки**  
**Факультет економіки та управління**  
**Кафедра Підприємництва і маркетингу**

**СИЛАБУС**

**Ризик та методи його вимірювання**  
**Рік навчання 2020/2021**

**I. Опис навчальної дисципліни**

| Найменування показників                | Галузь знань, спеціальність, освітньо-професійна програма, освітній рівень   | Характеристика навчальної дисципліни   |
|--|--|--|
| Денна/заочна форма навчання            | 07 Управління та адміністрування<br>073 Менеджмент<br>Управління фінансово-економічною безпекою<br>Менеджмент бізнес-структур<br>Магістр | <b>Вибіркова</b>   |
| Кількість годин/кредитів ECTS<br>120/4 |  | Рік навчання 2   |
|  |  | Семестр 3-ий   |
| ІНДЗ: <u>немає</u>                     |  | Лекції 20 год./12 годин  |
|  |  | Практичні (семінарські) 20 год./10 годин<br>Лабораторні 0 год.<br>Індивідуальні 0 год. |
|  |  | Самостійна робота 72 год./84 годин   |
|  |  | Консультації 8 год./14 годин   |
|  | Форма контролю: залік/залік  |  |

**II. Інформація про викладача**

Сак Тетяна Василівна, к.е.н., доцент кафедри підприємництва і маркетингу, моб. 0501994909, [Sak.Tatiana@eenu.edu.ua](mailto:Sak.Tatiana@eenu.edu.ua), G412

Дні занять розміщено на <http://194.44.187.20/cgi-bin/timetable.cgi?n=700>

**III. Опис дисципліни**

1. Анотація курсу. Дисципліна «Ризик та методи його вимірювання» належить до вибіркового навчального дисципліни і спрямована на засвоєння магістрантами методів та прийомів у сфері управління ризиками виробничо-господарської діяльності суб'єктів господарювання. Вивчення дисципліни спрямоване на формування у студентів практичних навичок і вмінь щодо ефективного прийняття управлінських рішень в умовах невизначеності та ризику; застосування методів вимірювання рівня економічного ризику та обґрунтування системи управління економічними ризиками та їх оптимізація.

2. Мета і завдання навчальної дисципліни. Метою навчальної дисципліни «Ризик та методи його вимірювання» є формування в студентів систематизованих знань щодо аналізу, моделювання, оцінки та управління ризиком, оволодіння сукупністю теоретичних і методичних питань, а також практичним досвідом проведення управлінського аналізу й оцінки ризиків діяльності підприємств.

Основними завданнями вивчення дисципліни є: засвоєння основних положень економічних ризиків, вивчення методичних підходів щодо аналізу ризику та управління ним; оволодіння навичками самостійно здійснювати аналіз, ідентифікацію та оцінювання ризику, використовуючи певні методи вимірювання ризиків.

3. Результати навчання (компетентності).

Загальні компетенції.

Здатність до фундаментального аналізу та синтезу на основі логічних аргументів та перевірених фактів (ЗК-2)

Здатність ідентифікувати та вирішувати економічні проблеми з використанням методів економічного аналізу та інноваційних підходів до прийняття господарських рішень (ЗК-4)

Фахові компетенції

Уміння діагностувати, оцінювати загрози навколишнього середовища економічних суб'єктів (ФК-4)

Уміння визначати, аналізувати та оцінювати дію загроз національній безпеці у різних сферах життєдіяльності; розробляти практичні рекомендації щодо підвищення ефективності діяльності системи забезпечення національної безпеки та її окремих ланок (ФК-8)

Програмні результати навчання

Уміння оцінювати ризики та управляти ними при забезпеченні фінансово-економічної безпеки організації (ПРН-20)

Попередні вимоги:

*Магістр повинен знати:* принципи раціональної поведінки в умовах, обтяжених ризиком; методи виявлення джерел ризику; класифікацію різних типів економічних ризиків; сутність основних принципів щодо аналізу, кількісної оцінки ступеня ризику; моделювання ризику, методи його зниження до допустимого рівня.

*Магістр повинен вміти:* виявляти різні види ризиків і на їх підставі приймати управлінські рішення; визначати чинники виникнення ризиків; використовувати методи оцінки ризиків; застосовувати способи оптимізації і зниження ризику; управляти ризиками діяльності підприємства.

4. Структура навчальної дисципліни.

Схема курсу денної/заочної форми навчання

| Назви змістових модулів і тем                                       | Усього годин денна/заочна <sup>1</sup> | Методи та технології викладання (навчання)   | Форма контролю. Бал оцінювання   |
|---|--|--|--|
| <b>Змістовий модуль 1. Методичні засади оцінювання ризику</b>       |  |  |  |
| Тема 1. Сутність економічного ризику                                | 4/2                                    | лекція-диспут, імітаційні вправи, симуляційні програми / Moodle, Google Classroom, Office 365 <sup>2</sup> . | усне опитування, ситуаційні завдання. Максимальна оцінка 4 бали                      |
| Тема 2. Види економічних ризиків та причини їх виникнення           | 4/2                                    | лекція-диспут, метод кейсів, імітаційні вправи / Moodle, Google Classroom, Office 365.                       | усне опитування, ситуаційні завдання. Максимальна оцінка 4 бали                      |
| Тема 3. Методичні засади якісного та кількісного оцінювання ризиків | 4/4                                    | бізнес тренінг, метод кейсів, імітаційні вправи / Moodle, Google Classroom, Office 365.                      | усне опитування, ситуаційні завдання, розв'язування задач, Максимальна оцінка 4 бали |

| Назви змістових модулів і тем  | Усього годин денна/заочна <sup>1</sup> | Методи та технології викладання (навчання)  | Форма контролю. Бал оцінювання  |
|--|--|---|---|
| Тема 4. Фінансові індикатори кількісного аналізу ризику  | 4/2                                    | бізнес тренінг, ділові ігри / Moodle, Clickers, Google Classroom, Office 365.                   | усне опитування, ситуаційні завдання, розв'язування задач. Максимальна оцінка 4 бали                      |
| Тема 5. Оцінювання ризиків інноваційної діяльності   | 4/2                                    | лекція-диспут, імітаційні вправи, симуляційні програми / Moodle, Google Classroom, Office 365.  | усне опитування, ситуаційні завдання, розв'язування задач. Максимальна оцінка 4 бали                      |
| Тема 6. Оцінювання фінансового та операційного ризику  | 4/2                                    | лекція-диспут, ділові ігри, метод кейсів / Moodle, Google Classroom, Office 365.                | усне опитування, ситуаційні завдання, розв'язування задач. Максимальна оцінка 4 бали                      |
| Разом за модулем 1   | 24/14                                  | Модульна контрольна робота / Moodle, Google Classroom, Office 365.                              | визначення термінів, розв'язування тестів, практичних завдань. Максимальна оцінка 30 балів                |
| <b>Змістовий модуль 2. Механізм реалізації корпоративних стратегій підприємств</b>             |  |   |   |
| Тема 7. Теорія корисності та її застосування в процесі управління ризиками                     | 4/2                                    | бізнес тренінг, імітаційні вправи, симуляційні програми / Moodle, Google Classroom, Office 365. | усне опитування, ситуаційні завдання. Максимальна оцінка 4 бали   |
| Тема 8. Прийняття оптимальних рішень в умовах невизначеності та ризику                         | 4/2                                    | бізнес тренінг, ділові ігри, метод кейсів / Moodle, Google Classroom, Office 365.               | усне опитування, ситуаційні завдання. Максимальна оцінка 4 бали   |
| Тема 9. Організація ризик-менеджменту на підприємстві  | 4/2                                    | бізнес тренінг, ділові ігри, метод кейсів / Moodle, Google Classroom, Office 365.               | усне опитування, ситуаційні завдання. Максимальна оцінка 4 бали.  |
| Тема 10. Особливості управління економічними ризиками в різних сферах господарської діяльності | 4/2                                    | лекція-диспут, імітаційні вправи, симуляційні програми / Moodle, Google Classroom, Office 365.  | усне опитування, ситуаційні завдання. Максимальна оцінка 4 бали   |
| Разом за модулем 2   | 16/8                                   | Модульна контрольна робота / Moodle, Google Classroom, Office 365.                              | визначення термінів, розв'язування тестів, ситуаційних та практичних завдань. Максимальна оцінка 30 балів |
| Разом  | 40/22                                  |   | Максимальна оцінка 100 балів.   |

*Примітки:* <sup>1</sup> *Всього годин лекцій і практичних занять.* <sup>2</sup> / Moodle, Clickers, Google Classroom, Office 365 – може застосовуватися одна з форм навчання або симбіоз у формі он-лайн лекцій для студентів з індивідуальним планом навчання або заочної форми навчання, а також в умовах карантинних обмежень.

5. Завдання для самостійного опрацювання.

#### **IV. Політика оцінювання**

Політика щодо академічної доброчесності.

Жодні форми порушення академічної доброчесності не толеруються. Усі письмові роботи перевіряються на наявність плагіату. Списування під час контрольних робіт та екзаменів заборонені.

Студентам потрібно пройти безкоштовний курс академічної доброчесності в університеті <https://vumonline.ua/course/academic-integrity-at-the-university/>

Політика щодо дедлайнів та перескладання.

Роботи, які здаються із порушенням термінів без поважних причин, оцінюються на нижчу оцінку (-1 бал). Перескладання відбувається із дозволу деканату за наявності поважних причин.

#### **Шкала оцінювання**

| Оцінка в балах за всі види навчальної діяльності | Оцінка       |
|--|--------------|
| 90 – 100   | Відмінно     |
| 82 – 89  | Дуже добре   |
| 75 - 81  | Добре        |
| 67 -74   | Задовільно   |
| 60 - 66  | Достатньо    |
| 1 – 59   | Незадовільно |

#### **V. Підсумковий контроль**

Залік відбувається у формі тестових завдань у Office 365 згідно розкладу. Тестові запитання складено відповідно до програми курсу. Містять 30 запитань з однією правильною відповіддю. Кожне запитання оцінюється в 2 бали. Максимальна оцінка 60 балів.

#### **VI. Рекомендована література та інтернет-ресурси**

##### *Основна література*

1. Балджи М.Д. Економічний ризик та методи його вимірювання. Навчальний посібник. Харків: Промарт, 2015. 300 с.
2. Вітлінський В. В. Ризикологія в економіці та підприємстві : Монографія. К. : КНЕУ, 2004. 480 с.
3. Внукова Н. М., Смоляк В. А. Економічна оцінка ризику діяльності підприємств : проблеми теорії та практики. Харків : ВД “ІНЖЕК”, 2006. 181 с.
4. Економічний ризик: методи оцінки та управління : навч. посібник / [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.
5. Івченко І. Ю. Економічні ризики : навчальний посібник. К. : Центр навчальної літератури, 2004. 304 с.
6. Лук’янова В. В. Економічний ризик : навчальний посібник. К. : Академвидав, 2007. 462 с.
7. Машина Н.І. Економічний ризик і методи його вимірювання: навчальний посібник. К.: ЦНЛ, 2003. 188 с.
8. Полінкевич О. М., Волинець І. Г. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання ризиків: навч. посіб. Луцьк : Вежа-Друк, 2018. 336 с.  
URL: [http://www.esnuir.eenu.edu.ua/bitstream/123456789/15846/1/Polinkevych\\_Volynets\\_OGR2018.pdf](http://www.esnuir.eenu.edu.ua/bitstream/123456789/15846/1/Polinkevych_Volynets_OGR2018.pdf)

9. Старостіна А.О., Кравченко В.А. Ризик-менеджмент: теорія та практика: навч. посіб. К.: ІВЦ “Видавництво «Політехніка»”, 2018. 200 с.
10. Федулова І. В., Скопенко Н.С. Економічні ризики та методи їх вимірювання : навч. посібник. К : Принтцентр, 2016. 298с.

*Додаткова література*

1. Горго І.О. Концепція формування системи управління ризиками на підприємстві. Економіка. Фінанси. Менеджмент: актуальні питання науки і практики. 2018. № 11. С. 44-57.
2. Горго І.О. Моделювання ризику при прийнятті управлінських рішень. Економічний дискурс.
3. Міжнародний науковий журнал. 2018. № 4. С. 74-81.
4. Кузнєцова Н. В. Фінансовий ризик-менеджмент з урахуванням інформаційних ризиків. Реєстрація, зберігання і обробка даних. 2018. Т.20. №1. С. 30–39.

*Інтернет-ресурси*

1. Компанія інтелектуальних технологій . URL: <https://kint.com.ua/ua/biznes-trenazher-vial>
2. Кейси. Краща практика. URL: <http://www.management.com.ua/cases/>
3. . Бизнес-кейсы. URL: <http://www.mbastrategy.ua/content/blogcategory/74/232/lang,Rus/>
4. Міжнародний Інститут Дослідження Ризиків URL: <http://www.miiir.ru>
5. ISO 31000. Менеджмент ризиків. URL: <https://www.iso.org/ru/iso-31000-risk-management.html>

*Викладач*

*Т.В. Сак*

*Затверджено на засіданні кафедри підприємництва і маркетингу  
Протокол №2 від 09.09.2020 р.*