

Силабус
освітнього компоненту
(за вибором здобувачів освіти)

Управління економічним ризиком

Назва дисципліни:	Управління економічним ризиком
Рівень вищої освіти:	перший (бакалаврський)
Галузь знань:	07 «Управління та адміністрування»
Спеціальність:	073 «Менеджмент»
Освітньо-професійна (освітньо-наукова) програма:	ОП «Менеджмент організацій і логістика»
Сторінка курсу в Moodle:	https://dl.khadi.kharkov.ua/course/view.php?id=534
Рік навчання:	4
Семестр:	7 (осінній)
Обсяг освітнього компоненту	4 кредити (120 годин)
Форма підсумкового контролю	Залік
Консультації:	за графіком
Назва кафедри:	кафедра менеджменту
Мова викладання:	українська
Керівник курсу:	Догадайло Яна Вікторівна, к.е.н., доцент
Контактний телефон:	+380687921122
E-mail:	svetlicwork@gmail.com

Короткий зміст освітнього компоненту:

Метою є формування системи теоретичних і прикладних знань про сутність економічного ризику, методи його ідентифікації та способи вимірювання, кількісні та якісні показники, інструменти управління ним та можливі шляхи подолання в умовах значної нестабільності економічної ситуації.

Предмет: методи і процеси управління економічним ризиком при здійсненні господарської діяльності; система методів управління та прийняття економічних рішень в умовах невизначеності та ризику.

Основними завданнями вивчення навчальної дисципліни є:

- розширення та поглиблення знань про якісні та кількісні властивості економічних процесів з урахуванням ризику як характерного чинника сучасної економіки;
- вивчення основ теорії та практики різних видів ризику; оволодіння методологією та методикою побудови, аналізу та застосування економіко-математичних моделей, які враховують ризик;
- вивчення ряду найбільш типових прийомів моделювання та вимірювання економічного ризику в процесі прийняття рішень, оволодіння відповідним апаратом з метою його практичного застосування при розв'язанні різноманітних проблем;
- оволодіння шляхами зменшення ризику без зменшення можливостей бізнесу.

Передумови для вивчення освітнього компоненту: дисципліна вивчається після вивчення дисциплін економічного напрямку.

Компетентності, яких набуває здобувач:

Загальні компетентності:

- ЗК3. Здатність до абстрактного мислення, аналізу, синтезу.
- ЗК4. Здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях.
- ЗК8. Навички використання інформаційних і комунікаційних технологій.
- ЗК9. Здатність вчитися і оволодівати сучасними знаннями.
- ЗК11. Здатність до адаптації та дії в новій ситуації.
- ЗК12. Здатність генерувати нові ідеї (креативність).
- ЗК13. Цінування та повага різноманітності та мультикультурності.

Спеціальні (фахові) компетентності:

- СК 1. Здатність визначати та описувати характеристики організації.
- СК 2. Здатність аналізувати результати діяльності організації, зіставляти їх з факторами впливу зовнішнього та внутрішнього середовища.
- СК 3. Здатність визначати перспективи розвитку організації.
- СК 4. Вміння визначати функціональні області організації та зв'язки між ними.
- СК 5. Здатність управляти організацією та її підрозділами через реалізацію функцій менеджменту.
- СК 6. Здатність діяти соціально відповідально і свідомо.
- СК 7. Здатність обирати та використовувати сучасний інструментарій менеджменту.
- СК 10. Здатність оцінювати виконувані роботи, забезпечувати їх якість та мотивувати персонал організації.
- СК 11. Здатність створювати та організовувати ефективні комунікації в процесі управління.
- СК 12. Здатність аналізувати й структурувати проблеми організації, формувати обґрунтовані рішення.

Результати навчання відповідно до освітньої програми:

- ПРН 4. Демонструвати навички виявлення проблем та обґрунтування управлінських рішень.
- ПРН 6. Виявляти навички пошуку, збирання та аналізу інформації, розрахунку показників для обґрунтування управлінських рішень.
- ПРН 7. Виявляти навички організаційного проектування.
- ПРН 8. Застосовувати методи менеджменту для забезпечення ефективності діяльності організації.
- ПРН 11. Демонструвати навички аналізу ситуації та здійснення комунікації у різних сферах діяльності організації.
- ПРН 16. Демонструвати навички самостійної роботи, гнучкого мислення, відкритості до нових знань, бути критичним і самокритичним.

Тематичний план

№ теми	Назва тем (ЛК, ЛР, ПР, СЗ, СР)	Кількість годин	
		очна	заочна
1	ЛК Поняття про ризик. Класифікація ризиків	4	1
	ПР Побудова платіжної матриці	2	1
	СР Головні проблеми прийняття рішень в умовах ризику та невизначеності. Основні джерела економічних ризиків	9	13
2	ЛК Процес управління ризиком в умовах соціальної відповідальності і свідомості	4	1
	ПР Аналіз чутливості прибутку	2	1
	СР Управління ризиком за напрямками діяльності підприємства	9	13
3	ЛК Методи виявлення ризику	4	1
	ПР Оцінка систематичного ризику	2	1
	СР Оцінка та облік ризику при прийнятті рішень	9	13
4	ЛК Аналіз ризиків	4	1
	ПР Проблеми оцінки та обліку ризику при прийнятті рішень	2	1
	СР Порівняльна характеристика методів аналізу ризиків	9	13
5	ЛК Фінансування ризиків	4	1
	ПР Оцінка доцільності витрат	2	1
	СР Порівняльна характеристика методів фінансування ризиків	9	13
6	ЛК Прийняття оптимальних ризиків з врахуванням невизначеності та ризику	4	1
	ПР Прийняття рішень в умовах часткової невизначеності середовища	2	1
	СР Прийняття рішень за допомогою «дерева рішень»	9	13
7	ЛК Методи впливу на ризик	4	1
	ПР Використання «дерева рішень» для вибору оптимальної стратегії в умовах ризику	2	1
	СР Види страхування	9	13
8	ЛК Програма управління ризиками	4	1
	ПР Аналіз ризиків підприємницької діяльності	2	1
	СР Маркетингові ризики	9	13
Разом	ЛК	32	8
	ПР (ЛР, СЗ)	16	8
	СР	72	104

Індивідуальне навчально-дослідне завдання (за наявності): не передбачене.

Методи навчання:

1) словесні:

1.1 традиційні: лекції, пояснення, розповідь тощо;

1.2 інтерактивні (нетрадиційні): проблемні лекції, дискусії тощо;

2) наочні: метод ілюстрацій, метод демонстрацій

3) практичні:

3.1 традиційні: практичні заняття, семінари;

3.2 інтерактивні (нетрадиційні): ділові ігри, тренінги, семінари-дискусії, «круглий стіл», аналіз реальних проблем, метод мозкової атаки.

Система оцінювання та вимоги:

Конкретизація, деталізація критеріїв та системи оцінювання з урахуванням специфіки освітнього компоненту здійснюється на основі загальних критеріїв, наведених у СТБНЗ 7.1-02:2018 «Положення про організацію освітнього процесу в ХНАДУ» (https://www.khadi.kharkov.ua/fileadmin/P_Ychebotdel/norm_dok/stvnz_7_1_02.pdf) та СТБНЗ 90.1-01:2021 «Оцінювання результатів навчання здобувачів вищої освіти» (https://www.khadi.kharkov.ua/fileadmin/P_Standart/pologeniya/stvnz-90.1-01_2021.pdf).

Поточна успішність

1 Поточна успішність здобувачів за виконання навчальних видів робіт на навчальних заняттях і за виконання завдань самостійної роботи оцінюється за допомогою п'ятибальної шкали оцінок з наступним перерахуванням у 100-бальною шкалу.

2 Оцінювання поточної успішності здобувачів вищої освіти здійснюється на кожному практичному занятті (лабораторному чи семінарському) за п'ятибальною шкалою («5», «4», «3», «2», «1») і заносяться у журнал обліку академічної успішності:

- «відмінно» («5»): здобувач бездоганно засвоїв теоретичний матеріал, демонструє глибокі знання з відповідної теми або навчальної дисципліни, основні положення;

- «добре» («4»): здобувач добре засвоїв теоретичний матеріал, володіє основними аспектами з першоджерел та рекомендованої літератури, аргументовано викладає його; має практичні навички, висловлює свої міркування з приводу тих чи інших проблем, але припускається певних неточностей і похибок у логіці викладу теоретичного змісту або при аналізі практичного;

- «задовільно» («3»): здобувач в основному опанував теоретичні знання навчальної теми, або дисципліни, орієнтується у першоджерелах та рекомендованій літературі, але непереконливо відповідає, плутає поняття, невпевнено відповідає на додаткові питання, не має стабільних знань; відповідаючи на питання практичного характеру, виявляє неточність у знаннях, не вміє оцінювати факти та явища, пов'язувати їх із майбутньою професією;

- «незадовільно» («2», «1»): здобувач не опанував навчальний матеріал теми (дисципліни), не знає наукових фактів, визначень, майже не орієнтується в першоджерелах та рекомендованій літературі, відсутнє наукове мислення, практичні навички не сформовані.

3 Під час оцінювання поточної успішності враховуються всі види робіт, передбачені навчальною програмою. Здобувач вищої освіти має отримати оцінку з кожної теми.

3.1 Лекційні заняття оцінюються шляхом визначення якості виконання конкретизованих завдань.

3.2 Практичні заняття оцінюються якістю виконання контрольного або індивідуального завдання, виконання та оформлення практичної роботи.

3.3 Лабораторні заняття оцінюються якістю виконання звітів про виконання лабораторних робіт.

3.4 Семінарські заняття оцінюються якістю виконання індивідуального завдання/реферату.

4 Підсумковий бал за поточну діяльність визнається як середньоарифметична сума балів за кожне заняття, за індивідуальну роботу, поточні контрольні роботи за формулою:

де $K^{поточ}$ – підсумкова оцінка успішності за результатами поточного контролю;
 $K1, K2, \dots, Kn$ – оцінка успішності n -го заходу поточного контролю;
 n – кількість заходів поточного контролю.

Таблиця 1 – Перерахунок середньої оцінки за поточну діяльність у багатобальну шкалу

Поточний контроль реалізується у формі опитування, експрес-контролю, контролю засвоєння навчального матеріалу, правильності виконання практичних завдань та розрахунків, у тому числі запланованих на самостійне опрацювання, захист індивідуального завдання (есе, реферату тощо).

Таблиця 2 – Розподіл балів з дисципліни за 100-бальною шкалою

[illegible]

Підсумкове оцінювання

1 Підсумковий контроль знань здобувачів з навчальної дисципліни здійснюється у формі заліку.

2 Здобувач вищої освіти отримує залік з дисципліни за результатами поточного оцінювання. Середня оцінка за поточну діяльність конвертується у бали за 100-бальною шкалою, відповідно до таблиці перерахунку (таблиця 1).

Здобувачі вищої освіти, які мають середню поточну оцінку з дисципліни нижче ніж «3» (60 балів), на останньому занятті можуть підвищити свій поточний бал шляхом складання тестів з дисципліни.

3 Умовою отримання заліку є:

- відпрацювання всіх пропущених занять;
- середня поточна оцінка з дисципліни не нижче «3» (60 балів).

4 Результат навчання оцінюється:

- за двобальною шкалою (зараховано/не зараховано) згідно з таблицею 3;
- за 100-бальною шкалою (для диференційованого заліку) відповідно до таблиці 4.

Таблиця 3 – Шкала переведення балів у національну систему оцінювання

За 100-бальною шкалою	За національною шкалою
від 60 балів до 100 балів	зараховано
менше 60 балів	не зараховано

Таблиця 4 – Шкала оцінювання знань здобувачів за результатами підсумкового контролю з навчальної дисципліни

Оцінка в балах	Оцінка за національною шкалою		Оцінка за шкалою ЄКТС	
	екзамен	залік	Оцінка	Критерії
90-100	Відмінно	Зараховано	A	Теоретичний зміст курсу освоєний цілком, без прогалин, необхідні практичні навички роботи з освоєним матеріалом сформовані, усі передбачені програмою навчання навчальні завдання виконані, якість їхнього виконання оцінено числом балів, близьким до максимального
80–89			B	Теоретичний зміст курсу освоєний цілком, без прогалин, необхідні практичні навички роботи з освоєним матеріалом в основному сформовані, усі передбачені програмою навчання навчальні завдання виконані, якість виконання більшості з них оцінено числом балів, близьким до максимального
75-79			C	Теоретичний зміст курсу освоєний цілком, без прогалин, деякі практичні навички роботи з освоєним матеріалом сформовані недостатньо, усі передбачені програмою навчання навчальні завдання виконані, якість виконання жодного з них не оцінено мінімальним числом балів, деякі види завдань виконані з помилками

Оцінка в балах	Оцінка за національною шкалою		Оцінка за шкалою ЄКТС	
	екзамен	залік	Оцінка	Критерії
67-74	Задовільно		D	Теоретичний зміст курсу освоєний частково, але прогалини не носять істотного характеру, необхідні практичні навички роботи з освоєним матеріалом в основному сформовані, більшість передбачених програмою навчання навчальних завдань виконано, деякі з виконаних завдань, можливо, містять помилки
60-66			E	Теоретичний зміст курсу освоєний частково, деякі практичні навички роботи не сформовані, багато передбачених програмою навчання навчальних завдань не виконані, або якість виконання деяких з них оцінено числом балів, близьким до мінімального.
35-59	Незадовільно	Не зараховано	FX	Теоретичний зміст курсу освоєний частково, необхідні практичні навички роботи не сформовані, більшість передбачених програм навчання навчальних завдань не виконано, або якість їхнього виконання оцінено числом балів, близьким до мінімального; при додатковій самостійній роботі над матеріалом курсу можливе підвищення якості виконання навчальних завдань (з можливістю повторного складання)
0-34	Неприйнятно		F	Теоретичний зміст курсу не освоєно, необхідні практичні навички роботи не сформовані, усі виконані навчальні завдання містять грубі помилки, додаткова самостійна робота над матеріалом курсу не приведе до якого-небудь значущого підвищення якості виконання навчальних завдань (з обов'язковим повторним курсом)

5 Із метою мотивації здобувачів до активного та якісного виконання всіх видів навчальної роботи протягом семестру до загальної підсумкової оцінки можуть бути додані заохочувальні бали. Мотивація здобувачів застосовується за умови виконання ними всіх видів навчальної роботи, які передбачені робочим навчальним планом підготовки здобувачів і робочою програмою з навчальної дисципліни.

6 За виконання індивідуальної самостійної роботи та участь у наукових заходах здобувачам нараховуються додаткові бали.

6.1 Додаткові бали додаються до суми балів, набраних здобувачем вищої освіти за поточну навчальну діяльність.

6.2 Кількість додаткових балів, яка нараховується за різні види індивідуальних завдань, залежить від їх об'єму та значимості:

- призові місця з дисципліни на міжнародному / всеукраїнському конкурсі

наукових студентських робіт – 20 балів;

- призові місця з дисципліни на всеукраїнських олімпіадах – 20 балів;
- участь у міжнародному / всеукраїнському конкурсі наукових студентських робіт – 15 балів;
- участь у міжнародних / всеукраїнських наукових конференціях студентів та молодих вчених – 12 балів;
- участь у всеукраїнських олімпіадах з дисципліни – 10 балів;
- участь в олімпіадах і наукових конференціях ХНАДУ з дисципліни – 5 балів;
- виконання індивідуальних науково-дослідних (навчально-дослідних) завдань підвищеної складності – 5 балів.

6.3 Кількість балів за індивідуальні завдання здобувача не може перевищувати 20 балів.

7 Загальна підсумкова оцінка за вивчення навчальної дисципліни не може перевищувати 100 балів. Загальна підсумкова оцінка за вивчення навчальної дисципліни визначається згідно зі шкалою, наведеною в таблиці 4.

Політика курсу:

- курс передбачає роботу в колективі, середовище в аудиторії є дружнім, творчим, відкритим до конструктивної критики;
- освоєння дисципліни передбачає обов'язкове відвідування лекцій і практичних занять, а також самостійну роботу;
- самостійна робота передбачає вивчення окремих тем навчальної дисципліни, які винесені відповідно до програми на самостійне опрацювання, або ж були розглянуті стисло;
- усі завдання, передбачені програмою, мають бути виконані у встановлений термін;
- якщо здобувач вищої освіти відсутній на заняттях з поважної причини, він презентує виконані завдання під час самостійної підготовки та консультації викладача;
- під час вивчення курсу здобувачі вищої освіти повинні дотримуватись правил академічної доброчесності, викладених у таких документах: «Правила академічної доброчесності учасників освітнього процесу ХНАДУ» (https://www.khadi.kharkov.ua/fileadmin/P_Standart/pologeniya/stvnz_67_01_dobroch_1.pdf), «Академічна доброчесність. Перевірка тексту академічних, наукових та кваліфікаційних робіт на плагіат» (https://www.khadi.kharkov.ua/fileadmin/P_Standart/pologeniya/stvnz_85_1_01.pdf), «Морально-етичний кодекс учасників освітнього процесу ХНАДУ» (https://www.khadi.kharkov.ua/fileadmin/P_Standart/pologeniya/stvnz_67_01_MEK_1.pdf).
- у разі виявлення факту плагіату здобувач отримує за завдання 0 балів і повинен повторно виконати завдання, які передбачені у силабусі;
- списування під час контрольних робіт та екзаменів заборонені (в т.ч. із використанням мобільних пристроїв). Мобільні пристрої дозволяється використовувати лише під час он-лайн тестування.

Рекомендована література:

1. Базова література

1.1. Господарський кодекс України [Електронний ресурс] URL: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/436-15#Text>

1.2 Бистрицька А.К., Догадайло Я.В. Управління економічним ризиком : консп. лекцій Харків : ХНАДУ, 2020. 87 с. URL : https://dl.khadi.kharkov.ua/pluginfile.php/233698/mod_resource/content/1/kons_upr_risk-

[1%202020%20%D0%BB%D0%B8%D1%82%20%D1%80%D0%B0%20%D1%81%D0%BE%D0%BA%D1%80%D0%B0%D1%89.pdf](http://metrology.com.ua/download/iso-iecshsas-i-dr/87-eea/1062-dstu-ies-iso-31010-2013)

- 1.3 Мороз В. М., Мороз С. А. Ризик-менеджмент : навч. посіб. Київ , 2019. 140 с.
- 1.4 Калініченко З.Д. Ризик-менеджмент: навч. посіб. Дніпро: ДДУВС, 2021. 224 с.
- 1.5 Метрологія, 2014. ДСТУ ІЕС/ISO 31010:2013. Національний стандарт України. Керування ризиком. Методи загального оцінювання ризику. [online] URL: <http://metrology.com.ua/download/iso-iecshsas-i-dr/87-eea/1062-dstu-ies-iso-31010-2013>.
- 1.6 ISO 31000:2018 Riskmanagement — Guidelines. [online] URL: <http://www.theirm.org/media/3513119/IRM-Report-ISO-31000-2018-v3.pdf>
- 1.7 Талеб Н.Н. Шкура у грі. К.: Наш формат, 2019. 432 с.
- 1.8 Свед М. Мислення за принципом Чорної скриньки. Як звести ризик до мінімуму. К. КМ-БУКС, 2018. 464 с.
- 1.9 Дуднєва Ю.Е. Ризик-менеджмент: інтегрований підхід до організації. *Економіка та суспільство*. 2019. № 20. С. 229–236.
- 1.10 Сосновська О.О., Деденко Л.В. Ризик-менеджмент як інструмент забезпечення стійкого функціонування підприємства в умовах невизначеності. *Європейський науковий журнал Економічних та Фінансових інновацій*. 2019. № 1(3). С. 70–79.
- 1.11 Nishimura A. Management, Uncertainty, and Accounting: Case Studies, Theoretical Models, and Useful Strategies. Palgrave Macmillan, 2019. 367 p.
- 1.12 Ostrom L., Wilhelmsen C. Risk Assessment: Tools, Techniques, and Their Applications : 2nd Edition. Wiley, 2019. 565 p.
- 1.13 Hopkin Paul. Fundamentals of Risk Management: Understanding, Evaluating and Implementing Effective Risk Management : . 5th ed. Kogan Page, 2018. 480 p.
- 1.14 Shivaani M.V. et al. Understanding Corporate Risk: A Study of Risk Measurement, Disclosure and Governance. Springer, 2019. 334 p.

2. Допоміжна література

- 2.1 Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків: Практичні заняття : навч. посіб. Київ : КПІ ім. Ігоря Сікорського, 2018. 48 с.
- 2.2 Кігель В.Р. Ризикологія: теоретичні основи та прикладні задачі, моделі і методи : навч. посіб. Київ : Міленіум, 2017. 230 с.
- 2.3 Данілова, Е. І. Концепція системного підходу до управління економічною безпекою підприємства: монографія. Вінниця: Європейська наукова платформа, 2020. 342 с.
- 2.4 Кривов'язюк І.В., Смерічевський С.Ф., Кулик Ю. М. Ризик-менеджмент логістичної системи машинобудівних підприємств. Монографія. Київ : Кондор, 2018. 200 с.
- 2.5 Нечипорук Л. В. Ризик-менеджмент: конспект лекцій. Харків: Нац. юрид.ун-т імені Ярослава Мудрого», 2019. 100 с.
- 2.6 Лісовська Ю. Кібербезпека. Ризики та заходи. К.: Кондор, 2019. 272 с.
- 2.7 Alfred Richard L. Brown D.J. Affective Decision Making Under Uncertainty: Risk, Ambiguity and Black Swans. Springer, 2020. 88 p.
- 2.8 Chapelle A. Operational Risk Management: Best Practices in the Financial Services Industry. Wiley, 2019. 272 p.
- 2.9 Chiara Crovini. Risk Management in Small and Medium Enterprises. Routledge, 2019. 107 p.
- 2.10 Harvey C.R., Rattray S., Van Hemert O. Strategic Risk Management: Designing Portfolios and Managing Risk. Wiley, 2021. 256 p.
- 2.11 Hubbard D. The Failure of Risk Management: Why It's Broken and How to Fix It : 2nd Edition. Wiley, 2020. 372 p.
- 2.12 Panchal D., Chatterjee P., Pamucar D., Tyagi M. (Eds.) Reliability and Risk Modeling of Engineering Systems. Springer, 2021. 178 p.

3. Додаткові джерела:

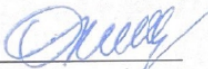
- 3.1 Дистанційний курс: <https://dl.khadi.kharkov.ua/course/view.php?id=534>
- 3.2 Безкоштовна бібліотека. URL: <http://www.management.com.ua>.
- 3.3 Бібліотека наукових праць провідних видавництв. URL: <https://link.springer.com/>; www.emeraldinsight.com/md.htm; www.interscience.wiley.com
- 3.4 Навчальні матеріали онлайн. URL: <https://pidru4niki.com/menedzhment/> ; <https://pidru4niki.com/ekonomika/>.
- 3.5 Національна бібліотека України ім. Вернадського. URL: <http://www.nbuv.gov.ua/node/901>.
- 3.6 Освіта.ua. Менеджмент. URL: <https://osvita.ua/vnz/reports/management/>.
- 3.7 Центр фінансово-економічних наукових досліджень. Бібліотека. URL: http://www.economics.in.ua/p/blog-page_45.html
- 3.8 Офіційний сайт департаменту статистики Організації Об'єднаних Націй [Електронний ресурс]. URL: <http://unstats.un.org/unsd/default.htm>.
- 3.9 Офіційний сайт державної служби статистики України [Електронний ресурс]. URL: <http://ukrstat.gov.ua>.
- 3.10 Офіційний сайт Інституту економіки та прогнозування Національної академії наук України [Електронний ресурс]. URL: <http://ief.org.ua>
- 3.11 Офіційний сайт Інституту економічних досліджень та політичних консультацій [Електронний ресурс]. URL: <http://www.ier.com.ua>

Розробник силабусу навчальної
дисципліни, к.е.н., доц.

Яна ДОГАДАЙЛО

(підпис)

Завідувач кафедри
менеджменту, д.е.н., проф.


(підпис)

Оксана КРИВОРУЧКО