

Силабус
освітнього компоненту
(за вибором здобувачів освіти)

Управління економічним ризиком

Назва дисципліни:	Управління економічним ризиком
Рівень вищої освіти:	перший (бакалаврський)
Сторінка курсу в Moodle:	https://dl2022.khadi-kh.com/course/view.php?id=534
Обсяг освітнього компоненту	4 кредити (120 годин)
Форма підсумкового контролю	Залік
Консультації:	за графіком
Назва кафедри:	кафедра менеджменту
Мова викладання:	українська
Керівник курсу:	Величко Яна Іванівна, асистент
Контактний телефон:	+380505050339
E-mail:	yana0505050@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.

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 основних дисциплін економічного напрямку, основ менеджменту, економіко-математичних методів.

Компетентності, яких набуває здобувач:

Загальні компетентності:

1. Здатність до абстрактного мислення, аналізу, синтезу.
2. Здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях.
3. Знання та розуміння предметної області та розуміння професійної діяльності.
4. Навички використання інформаційних і комунікаційних технологій.
5. Здатність до проведення досліджень на відповідному рівні.
6. Здатність до адаптації та дії в новій ситуації.
7. Здатність генерувати нові ідеї (креативність).

Спеціальні (фахові) компетентності:

1. Здатність аналізувати результати діяльності організації, зіставляти їх з факторами впливу зовнішнього та внутрішнього середовища.
2. Здатність визначати перспективи розвитку організації.
3. Вміння визначати функціональні області організації та зв'язки між ними.
4. Здатність управляти організацією та її підрозділами через реалізацію функцій менеджменту.
5. Здатність обирати та використовувати сучасний інструментарій менеджменту.
6. Здатність працювати в команді та налагоджувати міжособистісну взаємодію при вирішенні професійних завдань.
7. Здатність аналізувати й структурувати проблеми організації, формувати обґрунтовані рішення.

Результати навчання відповідно до освітньої програми:

1. Демонструвати навички виявлення проблем та обґрунтування управлінських рішень.
2. Виявляти навички пошуку, збирання та аналізу інформації, розрахунку показників для обґрунтування управлінських рішень.
3. Застосовувати методи менеджменту для забезпечення ефективності діяльності організації.
4. Демонструвати навички аналізу ситуації та здійснення комунікації у різних сферах діяльності організації.
5. Оцінювати правові, соціальні та економічні наслідки функціонування організації.
6. Демонструвати навички самостійної роботи, гнучкого мислення, відкритості до нових знань, бути критичним і самокритичним.
7. Виконувати дослідження індивідуально та/або в групі під керівництвом лідера.

Тематичний план

№ теми	Назва тем (ЛК, ЛР, ПР, СЗ, СР)	Кількість годин	
		очна	заочна
1	ЛК Поняття про ризик. Класифікація ризиків	4	2
	ПР Оцінка систематичного ризику	2	-
	СР Класифікація ризиків. Складання карти ризиків	4	10
2	ЛК Процес управління ризиком	2	1
	ПР Проблеми оцінки та обліку ризику при прийнятті рішень	2	-
	СР Механізм управління ризиком	4	10
3	ЛК Методи виявлення ризику	2	1
	ПР Моделювання ризику виробничої системи	2	-
	СР Опитування, як метод виявлення ризику	6	10
4	ЛК Аналіз ризиків	6	2
	ПР Прийняття рішень в умовах ризику	4	-
	ПР Використання «дерева рішень» для вибору оптимальної стратегії в умовах ризику	2	2
	СР Якісні та кількісні методи аналізу ризику	6	10
5	ЛК Фінансування ризиків	2	1
	ПР Аналіз чутливості витрат	2	-
	СР Методи покриття збитків підприємства	6	10
6	ЛК Прийняття оптимальних рішень з врахуванням невизначеності та ризику	4	2
	ПР Прийняття рішень в умовах повної невизначеності середовища	2	1
	ПР Прийняття рішень в умовах часткової невизначеності середовища	2	1
	СР Умови повної та часткової невизначеності середовища	6	10
7	ЛК Методи впливу на ризик	4	2
	ПР Метод аналізу чутливості (критичних значень)	2	-
	СР Зниження, збереження та передача ризиків	6	10
8	ЛК Програма управління ризиками	2	1
	ПР Групове прийняття рішень в умовах ризику	2	-
	СР Основні функції ризик - менеджера	6	10
9	ЛК Моделювання та оптимізація ризику при прийнятті рішень з реальних інвестицій	4	1
	ПР Оцінка ризику інвестиційного проекту методом аналізу сценаріїв	4	2
	ПР Оцінка ризику інвестиційного проекту за допомогою вірогідного методу	2	2
	СР Оцінка ринкової вартості підприємства та ризик	6	10
10	ЛК Особливості управління економічними ризиками в різних сферах господарської діяльності	2	1
	ПР Управління маркетинговими ризиками	4	-
	СР Управління промисловими, фінансовими, екологічними ризиками	6	8

№ теми	Назва тем (ЛК, ЛР, ПР, СЗ, СР)	Кількість годин	
		очна	заочна
Разом	ЛК	32	14
	ПР (ЛР, СЗ)	32	8
	СР	56	98

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-бальную 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:

$$K^{поточ} = \frac{K1 + K2 + \dots + Kn}{n},$$

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.

Оцінки конвертуються у бали згідно шкали перерахунку (таблиця 1).

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

4-бальна шкала	100-бальна шкала	4-бальна шкала	100-бальна шкала	4-бальна шкала	100-бальна шкала	4-бальна шкала	100-бальна шкала
5	100	4,45	89	3,90	78	3,35	67
4,95	99	4,4	88	3,85	77	3,3	66
4,9	98	4,35	87	3,80	76	3,25	65
4,85	97	4,3	86	3,75	75	3,2	64
4,8	96	4,25	85	3,7	74	3,15	63
4,75	95	4,20	84	3,65	73	3,1	62
4,7	94	4,15	83	3,60	72	3,05	61
4,65	93	4,10	82	3,55	71	3	60
4,6	92	4,05	81	3,5	70	від 1,78 до 2,99	від 35 до 59
						повторне складання	
4,55	91	4,00	80	3,45	69	від 0 до 1,77	від 0 до 34
4,5	90	3,95	79	3,4	68	повторне вивчення	

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).

Здобувач накопичує бали протягом семестру за виконання завдань, виступи на заняттях, участь у дискусіях, а також за виконання контрольних робіт (таблиця 2).

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

Види робіт	T1	T2	T3	T4	T5	T6	T7	T8	T9	T10	Оцінка в балах
Виступ, участь у дискусії на лекційних заняттях	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4	40
Захист практичних робіт	3	3	3	6	3	6	3	3	6	4	40
Індивідуальна самостійна робота (підготовка презентації, есе, реферату)	10					10					20
Сума балів за ЛК, ПР, СР											100
Контрольна робота 1	100					-					100
Контрольна робота 2	-					100					100
Середньоарифметична оцінка поточного контролю											100

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

Оцінка в балах	Оцінка за національною шкалою		Оцінка за шкалою ЄКТС	
	екзамен	залік	Оцінка	Критерії
80–89	Добре	Зараховано	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
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)

Оцінка в балах	Оцінка за національною шкалою		Оцінка за шкалою ЄКТС	
	екзамен	залік	Оцінка	Критерії
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 Закон України «Про основні засади державного нагляду (контролю) у сфері господарської діяльності». м. Київ, 5 квітня 2007 року, № 877-V. Відомості Верховної Ради України (ВВР), 2007. № 29. ст.389.
- 1.2 Господарський кодекс України [Електронний ресурс] URL: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/436-15#Text>
- 1.3 Балджи М.Д. Економічний ризик та методи його вимірювання. Навчальний посібник. Харків: Промарт, 2015. 300 с.
- 1.4 Васильєва Т.А., Кривич Я.М. Економічний ризик: методи оцінки та управління. Суми : ДВНЗ “УАБС НБУ”, 2015. 208 с.
- 1.5 Донець Л.І. Економічні ризики та методи їх вимірювання: Навчальний посібник. Київ: Центр навчальної літератури, 2006. 312 с.
- 1.6 Івченко І.Ю. Економічні ризики. Навчальний посібник. Київ: Центр навчальної літератури, 2004. 304 с.
- 1.7 Кучеренко В.Р., Карпов В.А., Карпов А.В. Економічний ризик та методи його вимірювання: Навчальний посібник. – Одеса, 2011.
- 1.8 Кравченко М.О., Бояринова К.О., Копішинська К.О. Управління ризиками: навчальний посібник. Київ : КПІ ім. Ігоря Сікорського, 2021. 432с.
- 1.9 Останкова Л.А., Шевченко Н.Ю. Аналіз, моделювання та управління економічними ризиками. Навч. посіб. Київ: Центр учбової літератури, 2011. 256 с.
- 1.10 Crouhy M. Risk management / M. Crouhy, D. Galai, R. Mark. McGraw-Hill, 2011. 717 p.

2. Допоміжна література

- 2.1 Ілляшенко С.М. Економічний ризик: навч. посібник / С.М. Ілляшенко. – К.: Центр навчальної літератури, 2004. – 220 с.
- 2.2 Івченко І.Ю. Економічні ризики: навч. посібник / І.Ю. Івченко. – К.: ЦУЛ, 2004. – 304 с.
- 2.3 Герасимчук Н. А., Мірзоева Т. В., Томашевська О. А. Економічні і фінансові ризики: навчальний посібник. Київ: Компринт, 2015. 288 с.
- 2.4 Економічний ризик: ігрові моделі: Навч. посібник / За ред. д-ра екон. наук, проф. В. В. Вітлінського. Київ: КНЕУ, 2002. 446 с.
- 2.5 Івченко І.Ю. Моделювання економічних ризиків і ризикових ситуацій. Навчальний посібник. Київ: Центр учбової літератури, 2007. 344 с.

- 2.6 Обґрунтування господарських рішень та оцінка ризиків: Навчальний посібник / М.Д. Балджи та ін. Одеса: ОНЕУ, 2013. 670 с.
- 2.7 Писаревський І.М., Стешенко О.Д. Управління ризиками. Навч. посібник. – Харків: ХНАМГ, 2008. 124 с.
- 2.8 Стешенко О. Д. Ризикологія: Навч. посібник. – Харків: УкрДУЗТ, 2019. 180 с.

3. Додаткові джерела:

- 3.1. Дистанційний курс: <https://dl2022.khadi-kh.com/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/management/> ; <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 ModelRisk. URL: <https://www.vosesoftware.com/products/modelrisk/>
- 3.11 Офіційний сайт Risk Simulator: вебсайт. URL: <https://www.realoptionsvaluation.com/risk-simulator>
- 3.12 Офіційний сайт RiskyProject: вебсайт. URL: <https://intaver.com/>
- 3.13 Офіційний сайт SIPmath: вебсайт. URL: <https://www.probabilitymanagement.org/sipmath-modeler-tools>

Розробник силабусу навчальної
дисципліни, асистент



Яна ВЕЛИЧКО

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



Оксана КРИВОРУЧКО