**ПЗВО «МІЖНАРОДНИЙ КЛАСИЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ**

**імені ПИЛИПА ОРЛИКА»**

Кафедра туризму та готельно-ресторанної справи

**СИЛАБУС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ**

**«УПРАВЛІННЯ РИЗИКОМ (ЗА ПРОФЕСІЙНИМ СПРЯМУВАННЯМ)»**

Освітня програма [Комп’ютерна інженерія](https://mku.edu.ua/wp-content/uploads/2019/10/osvitnya-programma-KI-m-kopyya1.docx)

Галузь знань: 12 Інформаційні технології

Спеціальність: 123 Комп’ютерна інженерія

Затверджено на засіданні кафедри

Протокол № 8 від ― 6 лютого 2020 р.

Миколаїв 2019-2020

|  |  |
| --- | --- |
| **Назва дисципліни** | «Управління ризиком» |
| **Викладач (-і)** | д. е.н., професор Звягінцева Ольга Борисівна |
| **Контактний тел.** | +380962501889 |
| **E-mail:** | Zvyginceve\_od@gmail.com |
| **Сторінка курсу в Moodle** | http://217.77.221.189:8081/course/view.php?id=9 |
| **Консультації** | Зазначте формат і розклад проведення консультацій  *Очні консультації*:  *12*.00- 13.00 – вівторок  14.00 до 15.00 - четвер  *Онлайн консультації:* за попередньою домовленістю Viber +380962501889) в робочі дні з 9.30 до 17.00 |

**1.Анотація курсу.**

Дисципліна ««Управління ризиком»» знайомить студентів з основами аналізу, діагностики, прогнозування, програмування і планування ризиків. Вивчення та облік невизначеності, конфліктності, багатокритеріальності й пов’язаного з ними ризику. Об’єкт управління ситуацією характеризується багатоваріантністю розвитку та можливістю виникнення непередбачених ситуацій. Таким чином, основними характеристиками сучасного фахівця є уміння працювати в умовах невизначеності, робити раціональний вибір із безлічі можливих альтернатив.

**Мета та завдання навчальної дисципліни**

Основною метою викладання навчальної дисципліни є знайомство з теоретичними основами ризик, оволодіння практикою застосування методів кількісної оцінки ризику в умовах ринкових відносин та прийняття ефективних управлінських рішень в ситуаціях невизначеності та ризику.

**1.3. Завдання вивчення навчальної дисципліни**

Завданнями вивчення навчальної дисципліни є:

- вивчення основ теорії ризику та практичне її використання в умовах невизначеності та ризику;

- одержання знань по головним питанням теорії прийняття рішень, реалізація яких потребує удосконалення або перегляду стратегії діяльності суб’єктів управління;

- оволодіння знаннями методів оцінки ризиків, які дають змогу оцінити рівень конкретного виду ризику за певним напрямком діяльності та і визначити конкретні шляхи його зниження.

- вивчення основ прийняття ефективних управлінських рішень в ситуаціях невизначеності та ризику.

У результаті вивчення даної навчальної дисципліни студент повинен:

**Знати:**

- суттєву характеристику організацій, підприємств та фірм різних форм власності, а також особливості їх функціонування в умовах невизначеності та ризику;

- сутність ризику та причини його виникнення, класифікацію ризиків та специфіку управління ними;

- засоби аналізу та кількісної оцінки ризиків з використанням апарата математичної статистики, аналітичних, експертних методів;

- класифікацію ризиків за ключовими ознаками;

- основні методи виявлення ризику;

- основні методи кількісного аналізу ризиків;

- основні поняття ризик;

- - основи організації процесу управління ризиком.

- шляхи та заходи зниження ступеню ризиків.

**Вміти:**

- ідентифікувати місцезнаходження прогнозованих чи виникаючих в процесі господарської діяльності ризиків в загальній системі їх класифікації;

- вибирати та використовувати засоби кількісної оцінки ступеня ризиків господарюючих суб’єктів;

- організовувати процес ефективного управління ризиком у випадку його реалізації.

- здійснювати якісний та кількісний аналіз ступеню ризику статистичним та експертним методами;

- здійснювати якісний та кількісний аналіз ступеню ризику аналітичним методом та методом аналогів;

- аналізувати ефективність методів управління ризиком;

Знання та вміння, отримані студентом під час вивчення даної навчальної дисципліни, використовуються в подальшому при вивченні багатьох наступних дисциплін професійної підготовки фахівця.

**4.Формат дисципліни**

Змішаний (blended)

викладання курсу передбачає поєднання традиційних форм аудиторного навчання з елементами електронного навчання, в якому використовуються спеціальні інформаційні технології, такі як комп’ютерна графіка, аудіо та відео, інтерактивні елементи, онлайн консультування і т.п.

**5. Пререквізити (Prerequisite)**

Дисципліни, що містять знання, уміння й навички, необхідні для освоєння курсу: для розуміння курсу«Управління ризиком» необхідні знання, набуті з таких дисциплін: «Підприємницька діяльність» та «Економіка підприємств».

**Обсяг дисципліни**

|  |  |
| --- | --- |
| Вид заняття | Загальна кількість годин |
| лекції | 30 год. |
| семінарські  заняття/практичні/лабораторні | 15 год. |
| самостійна робота | 90 год. |

**7.Ознаки дисципліни**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Курс  (рік навчання) | Семестр | Кількість кредитів/годин | Вид  підсумкового контролю | Нормативна/ вибіркова |
| 1-й | 2-й | 4,5/135 | залік | Вибіркова |

**8. Політика курсу**

**Політика виставлення балів.** Враховуються бали набрані на практичних заняттях,поточномутестуванні, самостійній роботі (реферати, презентації). При цьому обов’язково враховуються присутність на заняттях та активність студента під час практичного заняття; недопустимість пропусків та запізнень на заняття; користування мобільним телефоном, планшетом чи іншими мобільними пристроями під час заняття; несвоєчасне виконання поставленого завдання і т. ін.

Вимоги викладача. Кожен викладач ставить студентам систему вимог та правил поведінки студентів на заняттях, доводить до їх відома методичні рекомендації щодо виконання контрольних робіт, тестових завдань. Все це гарантує високу ефективність навчального процесу і є обов’язковою для студентів.

**Схема дисципліни**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Тема | Форма  заняття | Література | Вага оцінки | Матеріали | Завдання |
| **Тема 1. Функціонування фірм в умовах невизначеності та ризику.**  Предмет, методи і задачі дисципліни. Суттєва характеристика фірми. Функціонування фірми в умовах ризику. Внутрішнє і зовнішнє середовище господарювання. Виробничі засоби підприєм­ства. Фінансові засоби підприємства. Виробництво продукції. Фі­нансові результати діяльності. | Лекційне заняття | 1,2,3,4,5,6 |  | лекційний матеріал | Опрацювання  лекційного  матеріалу |
| **Тема 1. Функціонування фірм в умовах невизначеності та ризику.**  Предмет, методи і задачі дисципліни. Суттєва характеристика фірми. Функціонування фірми в умовах ризику. Внутрішнє і зовнішнє середовище господарювання. Виробничі засоби підприєм­ства. Фінансові засоби підприємства. Виробництво продукції. Фі­нансові результати діяльності. | Семінарське заняття | 1,2,3,4,5,6 | 1-7 | Таблиці, лекційний матеріал, підручники, комп’ютер | Опрацювання  лекційного  матеріалу |
| **Тема 2. Ризик та його різновиди. Класифікація ризиків.**  Поняття ризику і його різновиди. Сутність ризику і причини йо­го виникнення. Основні риси ризику. Функції ризику. Класифікація ризиків за належністю до країни функ­ціонування господарського суб'єкта, рівнем виникнення, сферою походження, причинами виникнення, ступенем обґрунтованості прийняття ризику, відповідністю припустимим межам | Лекційне заняття | 1,2,3,4,5,6 |  | лекційний матеріал | Опрацювання  лекційного  матеріалу |
| **Тема 2. Ризик та його різновиди. Класифікація ризиків.**  Поняття ризику і його різновиди. Сутність ризику і причини йо­го виникнення. Основні риси ризику. Функції ризику. Класифікація ризиків за належністю до країни функ­ціонування господарського суб'єкта, рівнем виникнення, сферою походження, причинами виникнення, ступенем обґрунтованості прийняття ризику, відповідністю припустимим межам | Семінарське заняття | 1,2,3,4,5,6 | 1-7 | Таблиці, лекційний матеріал, підручники, комп’ютер | Опрацювання  лекційного  матеріалу |
| **Тема 3. Якісний та кількісний аналіз економічного ризику**  Крива розподілу імовірності отримання прибутку. Крива розподілу ймовірностей втрат прибутку. Сутність якісного та кількісного аналізу ризиків. Принципи аналізу ризиків. Напрямки аналізу підприємницьких ризиків. Збитки, які виникають в процесі підприємницької діяльності. Методи аналізу ступеня ризику. | Лекційне заняття | 1,2,3,4,5,6 |  | лекційний матеріал | Опрацювання  лекційного  матеріалу |
| **Тема 3. Якісний та кількісний аналіз економічного ризику**  Крива розподілу імовірності отримання прибутку. Крива розподілу ймовірностей втрат прибутку. Сутність якісного та кількісного аналізу ризиків. Принципи аналізу ризиків. Напрямки аналізу підприємницьких ризиків. Збитки, які виникають в процесі підприємницької діяльності. Методи аналізу ступеня ризику. | Семінарське заняття | 1,2,3,4,5,6 | 1-7 | Таблиці, лекційний матеріал, підручники, комп’ютер | Опрацювання  лекційного  матеріалу |
| **Тема 4. Методи кількісної оцінки ступеня ризику: статистичний метод; метод аналізу доцільності витрат; метод експертних оцінок. Характеристика експертних процедур.**  Імовірність появи випадкової величини, математичне очікування випадкової величини, дисперсія, середньоквадратичне відхилення та коефіцієнт варіації випадкової величини.  Характеристика області абсолютної стійкості, нормальної стійкості, області нестійкого стану, критичного стану, кризового стану підприємства на основі кривої економічного ризику. | Лекційне заняття | 1,2,3,4,5,6 |  | лекційний матеріал | Опрацювання  лекційного  матеріалу |
| **Тема 4. Методи кількісної оцінки ступеня ризику: статистичний метод; метод аналізу доцільності витрат; метод експертних оцінок. Характеристика експертних процедур.**  Імовірність появи випадкової величини, математичне очікування випадкової величини, дисперсія, середньоквадратичне відхилення та коефіцієнт варіації випадкової величини.  Характеристика області абсолютної стійкості, нормальної стійкості, області нестійкого стану, критичного стану, кризового стану підприємства на основі кривої економічного ризику. | Семінарське заняття | 1,2,3,4,5,6 | 1-7 | Таблиці, лекційний матеріал, підручники, комп’ютер | Опрацювання  лекційного  матеріалу |
| **Тема 5. Методи кількісної оцінки ступеня ризику: аналітичний метод; метод використання аналогів. Комплексна оцінка ризиків.**  Визначення ключового параметру, вибір чинників впливу, програмування величини ключового параметру.  Визначення імовірності досліджуваного проекту на основі оцінок імовірності проектів-аналогів. | Лекційне заняття | 1,2,3,4,5,6 |  | лекційний матеріал | Опрацювання  лекційного  матеріалу |
| **Тема 6. Характеристика виробничих, маркетингових та фінансових ризиків.**  Поняття виробничих ризиків. Категорії виробничих ризиків. Безпосередньо виробничі ризики. Група ризиків, що виникають у процесі розробки стратегії фірми. Постачальницькі ризики. Група ризиків порушення планових термінів. | Лекційне заняття | 1,2,3,4,5,6 |  | лекційний матеріал | Опрацювання  лекційного  матеріалу |
| **Тема 6. Характеристика виробничих, маркетингових та фінансових ризиків.**  Поняття виробничих ризиків. Категорії виробничих ризиків. Безпосередньо виробничі ризики. Група ризиків, що виникають у процесі розробки стратегії фірми. Постачальницькі ризики. Група ризиків порушення планових термінів. | Семінарське заняття | 1,2,3,4,5,6 | 1-7 | Таблиці, лекційний матеріал, підручники, комп’ютер | Опрацювання  лекційного  матеріалу |
| **Тема 7. Методи управління економічними ризиками.**  Принципи управління ризиками. Система управління ризиками. Основи профілактики ризиків: диверсифікація та лімітування.  Самострахування, як метод зниження рівня ризиків. Страхування ризику.  Інформація в системі управління ризиками. | Лекційне заняття | 1,2,3,4,5,6 |  | лекційний матеріал | Опрацювання  лекційного  матеріалу |
| **Тема 8. Особливості управління фінансовими ризиками.**  Ризики, пов'язані з вкладенням капіталу (інвестиційні ризики): вкладення коштів у виробничу і невиробничу сфери економки; дія­льності фірми на фінансовому ринку.  Комплексне управління довгостроковими інвестиціями та оборотним капіталом підприємства. Економічна рентабельність активів підприємства. | Лекційне заняття | 1,2,3,4,5,6 |  | лекційний матеріал | Опрацювання  лекційного  матеріалу |
| **Тема 8. Особливості управління фінансовими ризиками.**  Ризики, пов'язані з вкладенням капіталу (інвестиційні ризики): вкладення коштів у виробничу і невиробничу сфери економки; дія­льності фірми на фінансовому ринку.  Комплексне управління довгостроковими інвестиціями та оборотним капіталом підприємства. Економічна рентабельність активів підприємства. | Семінарське заняття | 1,2,3,4,5,6 | 1-7 | Таблиці, лекційний матеріал, підручники, комп’ютер | Опрацювання  лекційного  матеріалу |

**Система оцінювання курсу**

**Критерії оцінювання та система розподілу балів**

**Поточний контроль з дисципліни** «Управління ризиком» – це оцінювання навчальних досягнень студента протягом навчального семестру за національною чотирибальною шкалою усіх видів аудиторної роботи (лекції та практичні заняття). Поточний контроль відображає поточні навчальні досягнення студента в освоєнні програмного матеріалу дисципліни; спрямований на необхідне корегування самостійної роботи студента.

Поточний контроль здійснюється лектором. Викладач розробляє чіткі критерії оцінювання всіх видів навчальної роботи у комплексному контролі знань, доводить їх до відома студентів на початку змістовного модулю.

*Система оцінювання аудиторної роботи***.**

Поточна аудиторна діяльність студента оцінюється за чотирибальною (національною) шкалою.

Форми участі студентів у навчальному процесі, які підлягають поточному контролю:

* виступ з основного питання;
* усна доповідь;
* доповнення, запитання до того, хто відповідає, рецензія на виступ;
* участь у дискусіях, інтерактивних формах організації заняття;
* аналіз джерельної та монографічної літератури;
* письмові завдання (тестові, контрольні, творчі роботи, реферати тощо);
* самостійне опрацювання тем;
* підготовка тез, конспектів навчальних або наукових текстів;
* систематичність роботи на семінарських заняттях, активність під час обговорення питань;
* та інші.

*Критеріями оцінки є:*

* 1. *для усних відповідей:*
  + повнота розкриття питання;
  + логіка викладання, культура мови;
  + емоційність та переконаність;
  + використання основної та додаткової літератури;
  + аналітичні міркування, уміння робити порівняння, висновки ;
  + та інші.
  1. *для виконання письмових завдань:*
  + повнота розкриття питання;
  + цілісність, системність, логічність, уміння формулювати висновки;
  + акуратність оформлення письмової роботи
  + та інші.

Студент, який не з’являвся на заняття (з поважних причин, підтверджених документально), а отже, не мав поточних оцінок, має право повторно пройти поточний контроль під час консультацій. На консультаціях студент може відпрацювати пропущені практичні заняття, а також ліквідувати заборгованості з інших видів навчальної роботи.

Система оцінювання самостійної роботи.

Самостійна робота студентів виділена як окремий елемент навчального модулю із встановленням для нього вагового коефіцієнта.

Контроль з дисципліни «Управління ризиком» проводиться 1 раз на семестр, і включає проведення контрольних заходів за всіма темами змістовного модуля у формі контрольної роботи, тестування, колоквіуму тощо. До контрольних заходів допускаються всі студенти незалежно від результатів поточного контролю. Лектор розробляє контрольні завдання (варіанти, тести тощо) для проведення модульного контролю.

Результати контрольного заходу студента, який не з’явився на нього, також оцінюються “незадовільно” незалежно від причини. Відпрацювання контрольного заходу є обов’язковим .

**Підсумковий (семестровий) контроль.**

Підсумковим контролем з дисципліни ««Управління ризиком» визначено навчальним планом – **залік**.

Підсумкова оцінка за вивчення предмета виставляється за шкалами: національною, 100 – бальною, ECTS і фіксується у відомості та заліковій книжці студента. Складений залік з оцінкою «незадовільно» не зараховується і до результату поточної успішності не додається. Щоб ліквідувати академ заборгованість з навчальної дисципліни, студент складає іспит повторно, при цьому результати поточної успішності зберігається.

Структура проведення семестрового контролю відображається доводиться до відома студентів на першому занятті.

**Система оцінювання та вимоги форми навчання**

**Очна (денна) форма навчання**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | Вид діяльності (завдання) | Критерії оцінювання | Максимальна кількість балів |
| 1 | Семінарські заняття | 7 семінарських занять. Максимальна кількість балів на семінарі – 7(7\*7) | 49 |
| 2 | Словник термінів | Кожен студент має дати визначення поняттям. | 10 |
| 3 | Написання та захист реферату | Оцінювання реферату:6 балів – написання реферату,5 балів – захист (презентація) | 11 |
| 4 | Іспит | В кожному заліковому білеті по 3 питання. Кожне питання оцінюється по 10 балів. | 30 |
|  | **Всього** |  | **100** |

**Заочна форма навчання**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | Вид діяльності (завдання) | Критерії оцінювання | Максимальна кількість балів |
| 1 | Семінарські заняття | 3семінарських занять. Максимальна кількість балів на семінарі – 10 (10\*3) | 30 |
| 2 | Словник термінів | Кожен студент має дати визначення поняттям. | 15 |
| 3 | Написання та захист реферату | Оцінювання реферату: 10 балів – написання реферату, 15 балів – захист (презентація) | 25 |
| 4 | Іспит | В кожному заліковому білеті по 3 питання. Кожне питання оцінюється по 10 балів. | 30 |
|  | **Всього** |  | **100** |

**Критерії оцінки рівня знань на семінарських/практичних/лабораторних заняттях.**

На семінарських/практичних/лабораторних заняттях кожен студент з кожної теми виконує індивідуальні завдання.

Рівень знань оцінюється: ***«відмінно»***– студент дає вичерпні, обґрунтовані, теоретично і практично правильні відповіді не менш ніж на 90% запитань, рішення задач та вправи є правильними, демонструє знання підручників, посібників, інструкцій, проводить узагальнення і висновки, акуратно оформляє завдання, був присутній на лекціях, має конспект лекцій чи реферати з основних тем курсу; ***«добре»*–** коли студент володіє знаннями матеріалу, але допускає незначні помилки у формуванні термінів, категорій і розрахунків, проте за допомогою викладача швидко орієнтується і знаходить правильні відповіді, був присутній на лекціях, має конспект лекцій чи реферати з основних тем курсу;

***«задовільно****»*– коли студент дає правильну відповідь не менше ніж на 60% питань, або на всі запитання дає

недостатньо обґрунтовані, невичерпні відповіді, допускає грубі помилки, які виправляє за допомогою викладача. При цьому враховується наявність конспекту за темою завдань та самостійність;

***«незадовільно з можливістю повторного складання»***– коли студент дає правильну відповідь не менше ніж на 35% питань, або на всі запитання дає необґрунтовані, невичерпні відповіді, допускає грубі помилки. Має неповний конспект лекцій. Підсумкова (загальна оцінка) курсу навчальної дисципліни є сумою рейтингових оцінок (балів), одержаних за окремі оцінювані форми навчальної діяльності: поточне та підсумкове засвоєння теоретичного матеріалу

**Рекомендована література**

**Базова**

1.  *Захаров К.В. та ін.* Логістика, ефективність і ризики зовнішньоекономічних операцій. - К.: Інтекс, 2000.

2. *Івченко І.Ю.* Економічні ризики: Навчальний посібник. – К.: ЦНЛ, 2004. – 304 с.

3. *Машина Н.І.* Економічний ризик і методи його вимірювання: Навчальний посібник. – К.: ЦНЛ, 2003. – 188 с.

**Додаткова**

[4.](http://www.lib.nau.edu.ua/search/Details.aspx?id=153566&lang=uk-UA)  *Гранатуров В.М.* Экономический риск. Сущность, методы измерения, пути снижения. – М.: [Дело и Сервис](http://www.ozon.ru/context/detail/id/858647/), 2010. – 208 с.

[5.](http://www.lib.nau.edu.ua/search/Details.aspx?id=153566&lang=uk-UA)  [*Балдин К.В., Воробьев*](http://www.ozon.ru/context/detail/id/4635951/#persons) *С. Н.* Модели и методы управления рисками в предпринимательстве. – М.: [МПСИ](http://www.ozon.ru/context/detail/id/858309/), [МОДЭК](http://www.ozon.ru/context/detail/id/856744/), 2009. – 432 с.

[6.](http://www.lib.nau.edu.ua/search/Details.aspx?id=153566&lang=uk-UA) *Хохлов Н.В.* Управление риском. – М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2001. – 239 с