

**МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ТЕРНОПІЛЬСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ ЕКОНОМІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ**

ЗАТВЕРДЖУЮ

Перший проректор

_____ М. І. Шинкарик

_____ 2020 р.



РОБОЧА ПРОГРАМА
з дисципліни
«Управління ризиками»

ступінь вищої освіти – бакалавр
галузь знань – 19 Архітектура та будівництво
спеціальність – 193 Геодезія та землеустрій
освітньо-професійна програма – «Геодезія та землеустрій»

кафедра економічної експертизи та землевпорядкування

Форма навчання	Курс	Семестр	Лекції (год.)	Практичні (год.)	ІРС, год.	Тренінг, год.	СРС, год.	Разом, год.	Залік
Денна	IV	VIII	24	16	2	4	104	150	VIII
Заочна	IV	VIII	4	2	–	–	144	150	VIII

Тернопіль – ТНЕУ
2020

Робочу програму склав доцент кафедри економічної експертизи та землевпорядкування канд. екон. наук, доцент Волошин Роман Володимирович

Розглянуто та схвалено групою забезпечення спеціальності Геодезія та землеустрій протокол № 1 від 27 серпня 2020 р.

Голова групи
забезпечення спеціальності
к.т.н., доцент



Руслан РОЗУМ

СТРУКТУРА РОБОЧОЇ ПРОГРАМИ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

“УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ”

1. ОПИС ДИСЦИПЛІНИ “УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ”

Дисципліна «Управління ризиками»	Галузь знань, спеціальність, ступінь вищої освіти	Характеристика навчальної дисципліни
Кількість кредитів ECTS – 5	Галузь знань 19 “Архітектура та будівництво”	Статус дисципліни Вибіркова Мова навчання українська
Кількість залікових модулів – 3	Спеціальність 193 “Геодезія та землеустрій” Освітні програми: Геодезія та землеустрій,	Рік підготовки – 4 Семестр: Денна – 8 Заочна – 8
Кількість змістових модулів – 3	Ступінь вищої освіти – бакалавр	Лекції: Денна – 24 год. Заочна – 4 год. Практичні заняття: Денна – 16 год. Заочна – 2 год.
Загальна кількість годин – 150		Самостійна робота (в т.ч. дуальна освіта): Денна - 108 год. (в т.ч. тренінги – 4 год.) Заочна – 144 год. Індивідуальна робота (КПЗ) – 2 год.
Тижневих годин – 18,75 з них аудиторних – 5		Вид підсумкового контролю – залік

2. МЕТА І ЗАВДАННЯ ВИВЧЕННЯ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ “УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ”

2.1. Мета вивчення навчальної дисципліни

Основною метою викладання курсу "Управління ризиками" є знайомство з теоретичними основами ризик-менеджменту, оволодіння практикою застосування методів кількісної оцінки ризику в умовах ринкових відносин та прийняття ефективних управлінських рішень в ситуаціях невизначеності та ризику.

2.2. Завдання вивчення навчальної дисципліни:

- вивчення основ теорії ризику та практичного її використання в великих економічних системах в умовах невизначеності та ризику;
- одержання знань з головних питань теорії прийняття рішень з урахуванням економічного ризику, реалізація яких потребує удосконалення або перегляду стратегії діяльності суб'єктів управління;
- оволодіння знаннями методів оцінки ризиків, які дають змогу визначити рівень конкретного виду ризику за певним напрямом підприємницької діяльності та запропонувати конкретні шляхи його зниження.
- набуття навиків діагностування ризиків та обставин, що їм передують та передбачення потенційних втрат підприємства внаслідок настання ризикованих ситуацій;
- вивчення методики прийняття ефективних управлінських рішень в ситуаціях невизначеності та ризику.

2.3. Найменування компетентностей, формування котрих забезпечує вивчення дисципліни:

У процесі викладання навчальної дисципліни «Управління ризиками» основна увага приділяється оволодінню студентами професійними компетентностями, а саме:

- володіння базовими категоріями та новітніми теоріями, концепціями, технологіями та методами, необхідними для виконання професійних функцій у сфері управлінської діяльності
- володіння практичними навичками з операційного менеджменту, розробки бізнес-планів, бізнес-стратегій, методами й технологіями стратегічного менеджменту
- уміння здійснювати проектний аналіз та управління міжнародним проектом з метою забезпечення його ефективної реалізації
- здатність застосовувати професійно-профільовані знання й практичні навички для розв'язання типових задач спеціальності та адаптації моделі управління до умов змінного середовища

2.4. Передумови для вивчення дисципліни.

Дисципліни, які були вивчені раніше: менеджмент та маркетинг в галузі, вища математика, статистика, еколого-правові відносини в землекористуванні.

2.5. Результати навчання.

У процесі викладання навчальної дисципліни «Управління ризиками» студенти повинні вміти і знати наступне:

- застосовувати сучасні технології та інструменти управління у різних сферах менеджменту;
- приймати стратегічні рішення в процесі управління підприємством на ринку, управляти і оцінювати стратегічний потенціал підприємства та формувати його конкурентні переваги, розраховувати показники бізнес-плану й оформляти зміст його розділів, формувати операційну стратегію підприємства;
- концептуальні засади теорії стратегічного управління та операційного менеджменту, основних підходів та алгоритму розробки бізнес-плану, методів та інструментів організаційного проектування;
- основні підходи та алгоритму розробки та реалізації міжнародних проектів із врахуванням сучасних тенденцій на міжнародних ринках;
- оперувати фаховою термінологією у сфері управління, здатність використовувати різноманітні методи для ефективного спілкування на професійному рівні;
- управління комплексними діями та проектами, відповідальність за прийняття рішень у непередбачуваних умовах.

3. ТЕОРЕТИЧНА ЧАСТИНА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ “УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ”

Змістовий модуль 1. Теоретичні засади управління ризиками

Тема 1. Ризик та його ключові характеристики

Предмет, методи і задачі дисципліни. Поняття невизначеності та ризику. Поняття повної, часткової невизначеності, повної визначеності. Причини виникнення невизначеності. Ситуація невизначеності і ситуація ризику. Особливості керування в умовах невизначеності.

Характеристики економічного ризику. Поняття ризик-менеджменту і його особливості в умовах конкурентної боротьби. Фактори виникнення економічного ризику та його функції. Сутність ризику і причини його виникнення. Основні риси ризику. Функції ризику. Класифікація ризиків

Література: [4; 8; 11; 13].

Тема 2. Теоретичні засади управління ризиками.

Сутність та актуальність управління ризиками. Різниця між ризик менеджментом та управління ризиками. Точність визначень. Причини актуальності ризик менеджменту. Фактори ризиків в Україні. Відмінність управління ризиками в Україні та за кордоном.

Переваги управління ризиками та їх вплив на управління компанією. Специфіка ризик середовища в Україні. Еволюція управління ризиками.

Література: [11; 12; 13; 14].

Тема 3. Управління ризиком на підприємстві

Організація управління ризиком. Документація, необхідна для управління ризиками. Програма управління ризиками. Установлення контексту ризику, його стратегічних і тактичних позицій. Виявлення факторів ризику. Оцінка ризику.

Методи виявлення ризику: традиційні і сучасні методи. Збитки компанії, ризик експозиції та їх класифікація. Методи управління ризиками та їх особливості. Фінансування ризику.

Література: [2; 3; 7; 10; 12].

Тема 4. Етапи реалізації програми управління ризиками на підприємстві

Відповідальність менеджменту за управління ризиком. Комплексний ризик менеджмент. Управління ризиками – ключові елементи процесу управління. Розробка схеми управління ризиком. Участь керівництва в управлінні ризиком. Стратегія реакції на ризик. Організація роботи відповідальних осіб в управлінні ризик-менеджментом. Штат працівників з ризику. Комунікації і навчання в управлінні ризиками.

Література: [1; 4; 9; 11; 15].

Змістовий модуль 2. Ідентифікація та управління ризиками

Тема 5. Операційний ризик-менеджмент

Особливості виявлення операційних ризиків. Найтипівіші методи виявлення операційних ризиків. Особливості оцінки імовірності операційних ризиків. Особливості аналізу операційних ризиків і фінансових інститутах. Процедурні ризики. Етапи управління операційними ризиками.

Література: [2; 3; 4; 7; 9].

Тема 6. Ризик менеджмент у сфері фінансів і кредиту

Фінанси, фінансові ринки, фінансовий менеджмент: їх роль і структура. Фінансовий ризик, його суть і класифікація. Принципи управління фінансовими ризиками. Як враховують фактор ризику у фінансових рішеннях. Показники ринкового ризику VaR і EaR. Схема управління фінансовими ризиками. Методи впливу на фінансові ризики.

Література: [4; 7; 9; 10; 13; 14].

Тема 7. Управління ризиками і маркетинг

Управління ризиками і маркетинг: сфери перетину, інтереси, зв'язок. Ідентифікація і класифікація ризиків у маркетингу. Управління ризиками під час проведення маркетингових досліджень. Споживчі ризики: ідентифікація і класифікація. Методологічні аспекти аналізу ринку споживача. Ризик і довіра. Сфера використання концепцій управління ризиками на споживчому ринку. Моделі виміру споживчого ринку. Практика аналізу споживчих ринків. Методологія маркетингового дослідження. Аналіз даних. Результати дослідження. Розробка маркетингового комплексу із урахуванням ризиків.

Література: [4; 8; 11; 13].

Тема 8. Управління ризиками у сфері зовнішньоекономічної діяльності

Основні види ризиків у зовнішньоекономічній діяльності. Ризики країни. Ризики вибору економічного партнера та його надійність. Транспортні ризики. Ризики зовнішньоекономічних контрактів. Аналіз і розрахунки ризиків на етапі підготовки до зовнішньоекономічної операції.

Література: [11; 12; 13; 14].

Змістовий модуль 2. Моделювання ризиків

Тема 9. Прийняття управлінських рішень в умовах ризику та невизначеності.

Поняття і сутність управлінських рішень. Процедура підготовки, прийняття та реалізації управлінських рішень. Методи розробки і прийняття управлінських рішень в системі ризик-менеджменту. Методи моделювання. Методи експертних оцінок. Моделі розробки і прийняття управлінських рішень та основні етапи їх побудови. Характеристика моделей теорії ігор. Зміст моделей теорії черг. Сутність моделей управління запасами. Особливості застосування моделей лінійного програмування. Характерні риси методів

експертних оцінок та особливості їх використання. Метод мозкової атаки. Метод Дельфі.

Література: [2; 3; 7; 10; 12].

Тема 10. Кількісний аналіз проектних ризиків і можливості їх комп'ютерного моделювання.

Проектні ризики. Методи аналізу ризиків інвестиційних проектів: метод корегування ставки дисконту, метод достовірних еквівалентів, аналіз чутливості, метод сценаріїв; дерево рішень імітаційне моделювання. Метод комп'ютерного імітаційного моделювання Монте-Карло.

Література: [1; 4; 9; 11; 15].

Тема 11. Використання спеціалізованого програмного забезпечення у сфері ризик менеджменту.

Імітаційне моделювання інвестиційних ризиків за допомогою Excel. Спеціалізовані програми @Risk і CristalBall: їх можливості, приклад використання. Правила роботи з @Risk. Використання CristalBall в економічному обґрунтуванні дипломного проекту. Спеціальні програми для управління ризиками в маркетингу.

Література: [2; 3; 4; 7; 9].

Тема 12. Психологічні аспекти прийняття економічних рішень в умовах невизначеності та ризику

Психологічні феномени процесу прийняття економічних рішень в умовах ризику та невизначеності. Особливості психологічних рис суб'єктів. Чинники психологічних зрушень. Теорія перспективи. Основна ідея теорії перспективи. Інваріантність поведінки. Асиметрія прийняття управлінських рішень. Вплив когнітивних спотворень на прийняття економічних (управлінських) рішень. Фреймінг-ефект або ефект обрамлення. Ілюзія контролю. Ілюзія прозорості. Ефекти в теорії ризику.

Література: [4; 7; 9; 10; 13; 14].

4. СТРУКТУРА ЗАЛІКОВОГО КРЕДИТУ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ “УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ»

Денна форма навчання

Теми	Кількість годин				Контрольні заходи
	лекції	практичні заняття	самостійна робота студента	індивідуальна робота студента	
<i>Змістовий модуль 1. Теоретичні засади управління ризиками</i>					
Тема 1. Ризик та його ключові характеристики	2	1	8	-	тестування
Тема 2. Теоретичні засади управління ризиками.	2	1	8	-	тестування
Тема 3. Управління ризиком на підприємстві	2	1	8	-	опитування
Тема 4. Етапи реалізації програми управління ризиками на підприємстві	2	1	8	-	тестування
<i>Змістовий модуль 2. Ідентифікація та управління ризиками</i>					
Тема 5. Операційний ризик-менеджмент	2	1	9	-	тестування
Тема 6. Ризик менеджмент у сфері фінансів і кредиту	2	1	9	-	тестування
Тема 7. Управління ризиками і маркетинг	2	2	9	1	тестування
Тема 8. Управління ризиками у сфері зовнішньоекономічної діяльності	2	2	9	-	Модуль 2 год.
<i>Змістовий модуль 3. Моделювання ризиків</i>					
Тема 9. Прийняття управлінських рішень в умовах ризику та невизначеності.	2	2	9	-	опитування
Тема 10. Кількісний аналіз проектних ризиків і можливості їх комп'ютерного моделювання.	2	1	9	-	тестування
Тема 11. Використання спеціалізованого програмного забезпечення у сфері ризик менеджменту.	2	1	9	1	РКР 2 год.
Тема 12. Психологічні аспекти прийняття економічних рішень в умовах невизначеності та ризику	2	2	9	-	КПЗ 2 год
Тренінг	-	-	4	-	Тренінг 4 год
Разом	24	16	108	2	

Заочна форма навчання

Теми	Кількість годин		
	лекції	практичні заняття	самостійна робота студента
<i>Змістовий модуль 1. Теоретичні засади управління ризиками</i>			
Тема 1. Ризик та його ключові характеристики			12
Тема 2. Теоретичні засади управління ризиками.			12
Тема 3. Управління ризиком на підприємстві		0,5	12
Тема 4. Етапи реалізації програми управління ризиками на підприємстві	0,5		12
<i>Змістовий модуль 2. Ідентифікація та управління ризиками</i>			
Тема 5. Операційний ризик-менеджмент			12
Тема 6. Ризик менеджмент у сфері фінансів і кредиту			12
Тема 7. Управління ризиками і маркетинг		0,5	12
Тема 8. Управління ризиками у сфері зовнішньоекономічної діяльності	0,5		12
<i>Змістовий модуль 3. Моделювання ризиків</i>			
Тема 9. Прийняття управлінських рішень в умовах ризику та невизначеності.		0,5	12
Тема 10. Кількісний аналіз проектних ризиків і можливості їх комп'ютерного моделювання.	0,5		12
Тема 11. Використання спеціалізованого програмного забезпечення у сфері ризик менеджменту.		0,5	12
Тема 12. Психологічні аспекти прийняття економічних рішень в умовах невизначеності та ризику	0,5		12
Разом	4	2	144

5. ТЕМАТИКА ПРАКТИЧНИХ ЗАНЯТЬ

ПРАКТИЧНЕ ЗАНЯТТЯ 1.

Тема 1. Ризик та його ключові характеристики

Мета: вивчити сутність ризику та його різновиди, зрозуміти особливості управління в умовах невизначеності, засвоїти функції ризику та переваги його застосування в умовах конкурентної боротьби.

Питання для обговорення:

1. Предмет, методи і задачі дисципліни. Поняття невизначеності та ризику.
 2. Особливості керування в умовах невизначеності.
 3. Характеристики економічного ризику.
 4. Поняття ризик-менеджменту і його особливості в умовах конкурентної боротьби.
 5. Сутність ризику і причини його виникнення. Основні риси ризику. Функції ризику.
 6. Класифікація ризиків
- Література: [4; 8; 11; 13].

Тема 2. Теоретичні засади управління ризиками.

Мета: Засвоїти особливості управління ризиками в Україні та світі, узагальнити фактори ризику в Україні, простежити еволюцію управління ризиками.

Питання для обговорення:

1. Сутність та актуальність управління ризиками.
 2. Причини актуальності ризик менеджменту.
 3. Фактори ризиків в Україні.
 4. Переваги управління ризиками, їх вплив на управління компанією.
 5. Специфіка ризик середовища в Україні.
 6. Еволюція управління ризиками.
- Література: [11; 12; 13; 14].

ПРАКТИЧНЕ ЗАНЯТТЯ 2.

Тема 3. Управління ризиком на підприємстві

Мета: засвоїти методiku виявлення та управління ризиками, набути навичок виявлення ризиків, зрозуміти особливості фінансування ризиків.

Питання для обговорення:

1. Організація управління ризиком.
 2. Документація, необхідна для управління ризиками.
 3. Виявлення факторів ризику. Оцінка ризику.
 4. Методи виявлення ризику: традиційні і сучасні методи.
 5. Методи управління ризиками та їх особливості.
 6. Фінансування ризику.
- Література: [2; 3; 7; 10; 12].

Тема 4. Етапи реалізації програми управління ризиками на підприємстві

Мета: засвоїти методіку формування програми управління ризиками, навчитися визначати відповідальних за ризики і забезпечувати організацію управління ризиками.

Питання для обговорення:

1. Відповідальність менеджменту за управління ризиком. Комплексний ризик менеджмент.
 2. Управління ризиками – ключові елементи процесу управління.
 3. Організація роботи відповідальних осіб в управлінні ризик-менеджментом.
 4. Комунікації і навчання в управлінні ризиками.
- Література: [1; 4; 9; 11; 15].

ПРАКТИЧНЕ ЗАНЯТТЯ 3.

Тема 5. Операційний ризик-менеджмент

Мета: Навчитися ідентифікувати особливості операційних ризиків та управляти ними.

Питання для обговорення:

1. Особливості виявлення операційних ризиків.
 2. Найтипівіші методи виявлення операційних ризиків.
 3. Особливості оцінки імовірності операційних ризиків.
 4. Особливості аналізу операційних ризиків і фінансових інститутах.
 5. Процедурні ризики.
 6. Етапи управління операційними ризиками.
- Література: [2; 3; 4; 7; 9].

Тема 6. Ризик менеджмент у сфері фінансів і кредиту

Мета: зрозуміти сутність та особливості фінансових ризиків, принципи управління ними і показники їх стану, засвоїти використання методів управління фінансовими ризиками.

Питання для обговорення:

1. Фінанси, фінансові ринки, фінансовий менеджмент: їх роль і структура.
 2. Фінансовий ризик, його суть і класифікація.
 3. Принципи управління фінансовими ризиками.
 4. Показники ринкового ризику VaR і EaR.
 5. Схема управління фінансовими ризиками.
 6. Методи впливу на фінансові ризики.
- Література: [4; 7; 9; 10; 13; 14].

ПРАКТИЧНЕ ЗАНЯТТЯ 4.

Тема 7. Управління ризиками і маркетинг

Мета: вивчити принципи та методи управління ризиками в сфері маркетингу, навчитися ідентифікувати споживчі ризики і розробляти маркетинговий комплекс із врахуванням ризиків.

Питання для обговорення:

1. Управління ризиками і маркетинг: сфери перетину, інтереси, зв'язок.
2. Ідентифікація і класифікація ризиків у маркетингу.
3. Управління ризиками під час проведення маркетингових досліджень.
4. Споживчі ризики: ідентифікація і класифікація.
5. Аналіз даних. Результати дослідження.
6. Розробка маркетингового комплексу із урахуванням ризиків.

Література: [4; 8; 11; 13].

ПРАКТИЧНЕ ЗАНЯТТЯ 5.

Тема 8. Управління ризиками у сфері ЗЕД

Мета: Засвоїти особливості управління ризиками в сфері зовнішньоекономічної діяльності.

Питання для обговорення:

1. Основні види ризиків у зовнішньоекономічній діяльності.
2. Ризики країни.
3. Ризики вибору економічного партнера та його надійність.
4. Транспортні ризики.
5. Ризики зовнішньоекономічних контрактів.
6. Аналіз і розрахунки ризиків на етапі підготовки до зовнішньоекономічної операції.

Література: [11; 12; 13; 14].

ПРАКТИЧНЕ ЗАНЯТТЯ 6.

Тема 9. Прийняття управлінських рішень в умовах ризику та невизначеності.

Мета: засвоїти методiku прийняття управлінських рішень в умовах ризику і невизначеності, закріпити теоретичні знання і розвинути практичні навички використання експертних методів в управлінні ризиками.

Питання для обговорення:

1. Поняття і сутність управлінських рішень.
2. Процедура підготовки, прийняття та реалізації управлінських рішень.
3. Методи розробки і прийняття управлінських рішень в системі ризик-менеджменту.
4. Характерні риси методів експертних оцінок та особливості їх використання.

Література: [2; 3; 7; 10; 12].

ПРАКТИЧНЕ ЗАНЯТТЯ 7.

Тема 10. Кількісний аналіз проектних ризиків і можливості їх комп'ютерного моделювання.

Мета: засвоїти методiku кількісного аналізу і комп'ютерного моделювання ризиків.

Питання для обговорення:

1. Проектні ризики.
2. Методи аналізу ризиків інвестиційних проектів.

3. Метод корегування ставки дисконту.
 4. Метод достовірних еквівалентів
 5. Аналіз чутливості.
 6. Метод сценаріїв.
 7. Дерево рішень.
 8. Імітаційне моделювання.
 9. Метод комп'ютерного імітаційного моделювання Монте-Карло.
- Література: [1; 4; 9; 11; 15].

Тема 11. Використання спеціалізованого програмного забезпечення у сфері ризик менеджменту.

Мета: засвоїти методику використання спеціального програмного забезпечення для управління ризиками.

Питання для обговорення:

1. Імітаційне моделювання інвестиційних ризиків за допомогою Excel.
 2. Спеціалізовані програми @Risk і CristalBall: їх можливості, приклад використання.
 3. Правила роботи з @Risk.
 4. Використання CristalBall в економічному обґрунтуванні дипломного проекту.
 5. Спеціальні програми для управління ризиками в маркетингу.
- Література: [4; 7; 9; 10; 13; 14].

ПРАКТИЧНЕ ЗАНЯТТЯ 8.

Тема 12. Психологічні аспекти прийняття економічних рішень в умовах невизначеності та ризику

Мета: зрозуміти та освоїти психологічні аспекти управління ризиками.

Питання для обговорення:

1. Психологічні феномени процесу прийняття економічних рішень в умовах ризику та невизначеності.
 2. Теорія перспективи.
 3. Асиметрія прийняття управлінських рішень.
 4. Вплив когнітивних спотворень на прийняття економічних (управлінських) рішень.
- Література: [4; 7; 9; 10; 13; 14].

6. КОМПЛЕКСНЕ ПРАКТИЧНЕ ІНДИВІДУАЛЬНЕ ЗАВДАННЯ (КПЗ)

Комплексне практичне індивідуальне завдання студента (КПЗ) є видом позааудиторної самостійної роботи студента навчально-дослідницького характеру, яке виконується в процесі вивчення програмного матеріалу навчальної дисципліни «Управління ризиками» і завершується разом із складанням підсумкового іспиту із даної дисципліни. Теоретико-практична робота в межах навчальної програми дисципліни, яка виконується на основі знань, умінь і навичок, одержаних в процесі лекційних та практичних занять, охоплює всі теми та зміст навчального курсу в цілому.

Мета: самостійне вивчення частини програмного матеріалу, систематизація, поглиблення, узагальнення, закріплення та практичне застосування знань студента з навчального курсу та розвиток навичок самостійної роботи.

Завершене КПЗ подається у вигляді скріпленого документу (зшитих аркушів паперу формату А4) з титульною сторінкою та внутрішнім наповненням змісту завдання. КПЗ подається викладачу, який читає лекційний курс з даної дисципліни. Оцінка за КПЗ виставляється на основі попереднього ознайомлення викладача зі змістом КПЗ і захистом завдання шляхом усного звіту студента про виконану роботу.

КПЗ оформляється у відповідності із встановленими вимогами. При виконанні та оформленні КПЗ студент може використовувати комп'ютерну техніку. Кожне КПЗ оцінюється за 100-бальною шкалою.

Комплексне практичне індивідуальне завдання (КПЗ) з дисципліни «Управління ризиками» виконується самостійно кожним студентом.

7. САМОСТІЙНА РОБОТА

Перелік питань для самостійного опрацювання з дисципліни «Управління ризиками»:

№ п/п	Тематика
1	2
1.	Наведіть приклади економічних рішень, обтяжених ризиком.
2.	Поясніть природу підприємницького ризику.
3.	Проаналізуйте систему постулатів стосовно ризику як економічної категорії. Наведіть відповідні приклади.
4.	Дайте визначення підприємницького ризику. Поясніть його сутність. Поясніть основні причини виникнення економічного ризику.
5.	Охарактеризуйте види невизначеності.
6.	Дайте визначення основних суб'єктів економічного ризику.
7.	Поясніть сутність поняття: джерело економічного ризику.
8.	Поясніть сутність поняття: об'єкт економічного ризику.
9.	Які існують підходи до класифікації ризиків?

1	2
10.	Поясніть, який існує взаємозв'язок між ризиком і прибутком з позиції фінансового менеджменту.
11.	Поясніть сутність поняття: структура фінансового ризику.
12.	Стратегія управління ризиками – це напрямки і засоби управління ризиком?
13.	Прийоми зниження ризику – це запобігання, утримання та передача ризику?
14.	Диверсифікація є визначенням межі ризикового вкладення капіталу?
15.	Найпоширенішим методом зниження ступеня фінансового ризику є придбання додаткової інформації про вибір і можливі результати?
16.	Страховання ризику є найбільш розповсюдженим способом зниження ступеня ризику?
17.	Ризик можна знизити, якщо розподілити капітал між різними об'єктами вкладення (диверсифікованість)
18.	Еккаутинг сприяє зниженню фінансового ризику?
19.	У чому полягає сутність поняття кількісного аналізу ризику у фінансовому менеджменті? Наведіть приклади.
20.	У чому полягає сутність кількісного аналізу ризику за допомогою методів імітаційного моделювання? Сформулюйте умови, за яких можливе використання цих методів.
21.	На які зони розбивають діапазон значень можливих збитків? Сформулюйте умови, за яких можливе використання цих методів.
22.	За яких гіпотез здійснюється побудова кривої щільності розподілу ймовірності збитків? Побудуйте схематично цю криву і проаналізуйте її характерні точки.
23.	Чи є сенс реалізовувати проект, якщо точка максимуму функції щільності знаходиться у зоні критичних збитків? Чому?
24.	Наведіть базові показники підприємницького ризику. В чому полягає їх сутність?
25.	У чому полягає сутність понять статистична та нестатистична (суб'єктивна) ймовірність?
26.	Сформулюйте засади кількісного аналізу ризику методом аналогій.
27.	Розкрийте сутність та основні кроки проведення аналізу ризику методом аналізу чутливості. Наведіть відповідний приклад.
28.	Чому для кількісного вимірювання величини ризику у фінансовому менеджменті використовують кілька показників? Наведіть окремі з них.
29.	Основні принципи, які покладені в основу класифікації інформаційних ситуацій. Матриця ризику, зміст, її побудова. Сутність критерію Севіджа.
30.	Чому в процесі обґрунтування прийняття економічних рішень виникають багатокритеріальні задачі? У чому полягає їхня сутність?
31.	Поясніть сутність критерію Парето. Проілюструйте метод виокремлення Паретових розв'язків на прикладі з двома критеріями.
32.	Наведіть структурну схему процесу побудови ієрархічних моделей обґрунтування прийняття багатокритеріальних рішень. Поясніть сутність основних етапів цієї схеми.
33.	Які основні чинники є характерними для проблеми обґрунтування прийняття багатоцільових рішень?

1	2
34.	Розкрийте зміст основних етапів процесу управління ризиком на туристських підприємствах.
35.	Наведіть приклади ситуацій, коли доцільно використовувати зовнішні способи оптимізації ризику на тур підприємствах.
36.	Поясніть сутність лімітування й доцільності його застосування щодо зниження рівня фінансових ризиків. Наведіть відповідний приклад.
37.	У яких випадках доцільно й можливо застосовувати страхування як спосіб зниження ризику?
38.	У чому полягає сутність таких фінансових інструментів, як опціони та ф'ючерси? Наведіть приклади їх використання для зниження ступеня ризику.
39.	Інвестиційна діяльність підприємства, характеристика та оцінка ризику.
40.	Основи класифікації ризикових інвестицій.
41.	Організаційно-інформаційна модель аналізу ризику інвестиційної діяльності підприємства.
42.	Методика аналізу ризику інвестиційної діяльності підприємства.
43.	Аналіз ризику реальних інвестицій.
44.	Аналіз ризику фінансових інвестицій.
45.	Критерії економічного зростання підприємства.
46.	Аналіз та оцінка ймовірного банкрутства підприємства.

8. ТРЕНІНГ З ДИСЦИПЛІНИ

Тематика тренінгу

1. Ідентифікація ризиків.
2. Формування карти ризиків.
3. Розробка системи управління ризиками.

Організація і проведення тренінгу

Вступна частина проводиться з метою ознайомлення студентів з темою тренінгового заняття.

Організаційна частина полягає у створенні робочого настрою у колективі студентів, визначенні правил проведення тренінгового заняття. Матеріали для опрацювання подаються у формі бізнес-кейсів.

Практична частина реалізовується шляхом виконання завдань у групах студентів у кількості 3-5 осіб з визначених питань теми тренінгового заняття.

Підведення підсумків. Обговорюються результати виконаних завдань у групах. Обмін думками з питань, які виносилися на тренінгові заняття.

9. ЗАСОБИ ОЦІНЮВАННЯ ТА МЕТОДИ ДЕМОНСТРУВАННЯ РЕЗУЛЬТАТІВ НАВЧАННЯ

У процесі вивчення дисципліни «Управління ризиками» використовуються наступні засоби оцінювання та методи демонстрування результатів навчання:

- поточне опитування;
- залікове модульне тестування та опитування;
- розрахункові та розрахунково-графічні роботи;
- презентації результатів виконаних завдань та досліджень;
- оцінювання результатів КППЗ;
- студентські презентації та виступи на наукових заходах;
- розрахункові роботи;
- ректорська контрольна робота;
- інші види індивідуальних та групових завдань.

10. КРИТЕРІЇ, ФОРМИ ПОТОЧНОГО ТА ПІДСУМКОВОГО КОНТРОЛЮ

Підсумковий бал (за 100-бальною шкалою) навчальної дисципліни «Управління ризиками» визначається як середньозважена величина, в залежності від питомої ваги кожної складової залікового кредиту, % :

Заліковий модуль 1	Заліковий модуль 2 (ректорська контрольна робота)	Заліковий модуль 3 (підсумкова оцінка за КППЗ враховуючи поточне опитування)
30%	40 %	30 %

Шкала оцінок:

За шкалою Університету	За національною шкалою	За шкалою ECTS
90-100	відмінно	A (відмінно)
85-89	добре	B (дуже добре)
75-84		C (добре)
65-74	задовільно	D (задовільно)
60-64		E (достатньо)
35-59	незадовільно	FX (незадовільно з можливістю повторного складання)
1-34		F (незадовільно з обов'язковим повторним курсом)

11. ІНСТРУМЕНТИ, ОБЛАДНАННЯ ТА ПРОГРАМНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ, ВИКОРИСТАННЯ ЯКИХ ПЕРЕДБАЧАЄ НАВЧАЛЬНА ДИСЦИПЛІНА

	Найменування	Номер теми
1	Проектор ViewSonic PJ 7223 (1 шт.)	1–12
2	Підключення до комп'ютера на процесорі Intel Celeron CPU G540 (2,5 GHz RAM 2Gb, HDD 500 Gb). Монітор Philips 193vV5LSB2 (1 шт.)	1–12
3	Базове програмне забезпечення: ОС Windows 10 – згідно ліцензії Microsoft IT Academy та Microsoft DreamSpark for Students	1–12
4	Програмне забезпечення базових інформаційних технологій: MS Office, телекомунікаційне програмне забезпечення (Internet Explorer, Opera, Google Chrome, Firefox)	1–12

РЕКОМЕНДОВАНІ ДЖЕРЕЛА ІНФОРМАЦІЇ

Закони:

1. Конституція України. URL: <http://zakon.rada.gov.ua/laws/main/254к/96-вр>.
2. Господарський Кодекс України. URL: <http://zakon.rada.gov.ua/laws/show/436-15>.
3. Закон України «Про акціонерні товариства». URL: <http://zakon.rada.gov.ua/laws/main/514-17>.
4. Закон України «Про господарські товариства». URL: <http://zakon.rada.gov.ua/laws/main/1576-12>.
5. Закон України «Про кооперацію». URL: <http://zakon.rada.gov.ua/laws/show/1087-15>.
6. Закон України «Про ліцензування видів господарської діяльності». URL: <http://zakon.rada.gov.ua/laws/show/222-19>.
7. Закон України «Про розвиток та державну підтримку малого і середнього підприємництва в Україні». URL: <http://zakon.rada.gov.ua/laws/show/4618-17>.
8. Закон України «Про товариства з обмеженою та додатковою відповідальністю». URL: <http://zakon.rada.gov.ua/laws/show/2275-19>. – Назва з екрану.
9. Податковий Кодекс України. URL: <http://zakon.rada.gov.ua/laws/main/2755-17>.
10. Цивільний Кодекс України. URL: <http://zakon.rada.gov.ua/laws/show/435-15>.

Основна:

11. Балджи М.Д. Економічний ризик та методи його вимірювання : навчальний посібник. Харків: Промарт, 2015. 300 с.
12. Вітлінський В. В. Ризикологія в економіці та підприємстві: Монографія. К.: КНЕУ, 2014. 480 с.

13. 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.

14. Загурський О. Управління ризиками. К.: Університет Україна, 2016. 244 с.

15. Кучеренко В.Р., Карпов В.А., Карпов А.В. Економічний ризик та методи його вимірювання : навчальний посібник. Одеса, 2017. 200 с.

16. Лісовська Ю. Кібербезпека. Ризики та заходи. К.: Кондор, 2019. 272 с.

17. Логвінова О. П., Семененко І. М. Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків: навч. посіб. Х. : Вид-во «Лідер», 2015. 370 с.

18. Матвійчук А. В. Аналіз і управління економічним ризиком: навч. посіб. К.: Центр навчальної літератури, 2015. 224 с.

19. Мостенська Т., Шинкарук Л. Інвестиційний менеджмент. Навчальний посібник. К. Кондор, 2017. 308 с.

20. Посохов І. М. Управління ризиками у підприємстві: навчальний посібник. Харків : НТУ «ХПІ», 2015. 220 с.

21. Ризик у ринковій економіці: навч. посіб. за ред .Т. Є. Андрєєва, Т. Е. Петровська. Харків: Бурун Книга, 2015. 128с.

22. Свед М. Мислення за принципом Чорної скриньки. Як звести ризик до мінімуму. К. КМ-БУКС, 2018. 464 с.

23. Стрельбіцька Н. Є. Становлення та розвиток міжнародних стандартів управління ризиками. *Вісник КНТЕУ*. 2015. № 6. С. 84-93.

24. Сулим М., Пенцак О. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання ризиків : Підручник для студентів вищих навчальних закладів. Львів: «Новий світ 2000», 2015. 330 с.

25. Талєб Н.Н. Шкура у грі. К.: Наш формат, 2019. 432 с.

26. Теоретико-методологічні основи аналізу та врахування господарського ризику в діяльності підприємств : Монографія ; керівник авт. кол. проф. Н.С.Скопенко. К.: Кондор-Видавництво, 2015. 301 с.

27. Управління ризиками на підприємствах харчової промисловості : Монографія ; керівник авт. кол. проф. І.В.Федулова. К. : ЦП «Принтцентр», 2016. 321 с.

28. Управління фінансовими ризиками : навч. посібник / Куцик П.О., Васильців Т.Г., Сороківський В.М., Стефаняк В.І., Сороківська М.В. Львів : Растр-7, 2016. 318 с.

Додаткова:

29. Андрєєва Т. Є., Петровська Т. Е. Ризик у ринковій економіці: навч. посіб. Харків: Бурун Книга, 2015. 128с.

30. Білорус О. Г. Економічна система глобалізму. К.: КНЕУ, 2013. 360 с.

31. Вітлінський В. В., Верченко П. І., Сігал А. В., Наконечний Я. С. Економічний ризик: ігрові моделі: навч. посіб. за ред. В. В. Вітлінського. К.: КНЕУ, 2012. 448 с.

32. Донець Л. Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків. К. ЦУЛ, 2012. 464 с.
33. Івченко І. Ю. Економічні ризики: навч. посіб. Київ: Центр навчальної літератури, 2014. 304 с.
34. Канеман Д. Думай медленно... решай быстро. М.: АСТ, 2014. 653 с.
35. Коваленко В. Фінансові ризики та шляхи їх мінімізації. Правовий аспект. К.: Знання, 2011. 320 с.
36. Ковальчук Т. Макроекономічні ризики. Класифікаційні ознаки, способи виміру, шляхи мінімізації. К.: Знання, 2012. 301 с.
37. Кривов'язюк І., Смерічевський С. Кулик Ю. Ризик-менеджмент логістичної системи машинобудівних підприємств. К.: Кондор, 2014. 288 с.
38. Лук'янова В. Економічний ризик: навч. посіб. К.: Академвидав, 2007. 464 с.
39. Міжнародний стандарт управління ризиками Федерації Європейських Асоціацій Ризик-менеджерів. - Режим доступу : [a-risk-management-standard-english-version](#)
40. Примостка Л. Управління банківськими ризиками. К. КНЕУ, 2009. 600 с.
41. Сергеева О., Донець Л. Шепеленко О. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання ризиків. К.: ЦУЛ, 2012. 472 с.
42. Сорока П., Сорока Б. Аналіз, моделювання та управління ризиками. К.: Університет Україна, 2011. 270 с.
43. Сохацька О. М. Біржова справа. Підручник. 2-ге вид. змін. й доп. Тернопіль: Карт-бланш, К.: Кондор, 2008. 632 с.
44. Старостіна А. О. Ризик-менеджмент. Теорія та практика: навч. посіб. К.: ІВЦ Політехніка, 2014. 200 с.
45. Ястремський О. І. Моделювання економічного ризику. К.: Либідь, 2012. 176 с.