

**МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ**  
**ДВНЗ «ПРИКАРПАТСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ**  
**ІМЕНІ ВАСИЛЯ СТЕФАНІКА»**

Факультет/інститут економічний

Кафедра теоретичної і прикладної економіки

**СИЛАБУС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІН**

**Управління ризиками у підприємстві, торгівлі та  
біржовій діяльності**

Освітня програма Підприємництво, торгівля і біржова діяльність

Спеціальність 076 Підприємництво, торгівля і біржова діяльність

Галузь знань 07 Управління та адміністрування

Затверджено на засіданні кафедри  
Протокол № 1 від 29 серпня 2019 р.

## **ЗМІСТ**

1. Загальна інформація
2. Анотація до курсу
3. Мета та цілі курсу
4. Результати навчання (компетентності)
5. Організація навчання курсу
6. Система оцінювання курсу
7. Політика курсу
8. Рекомендована література

<b>1. Загальна інформація</b>	
<b>Назва дисципліни</b>	Управління ризиками у підприємстві, торгівлі та біржовій діяльності
<b>Викладач (-і)</b>	к.е.н., доц. Стефінін В.В., к.е.н., Феденчук Я.М.
<b>Контактний телефон викладача</b>	+38(067)2992171, +38(066)1058431
<b>Е-mail викладача</b>	<a href="mailto:volodymyr.stefinin@pnu.edu.ua">volodymyr.stefinin@pnu.edu.ua</a> , <a href="mailto:slava.fed@i.ua">slava.fed@i.ua</a>
<b>Формат дисципліни</b>	Очний/заочний
<b>Обсяг дисципліни</b>	3 ECTS
<b>Посилання на сайт дистанційного навчання</b>	<a href="http://www.d-learn.pu.if.ua">http://www.d-learn.pu.if.ua</a>
<b>Консультації</b>	Очні консультації: згідно розкладу консультацій
<b>2. Анотація до курсу</b>	
<p>Дисципліна «Управління ризиками у підприємстві, торгівлі та біржовій діяльності» набуває особливої актуальності – має методичну та практичну спрямованість на вирішення широкого спектра питань на усіх рівнях ієрархії управління та прийняття рішень (планів, програм, проектів, стратегій тощо) у підприємстві та управлінні, є однією з основних дисциплін у процесі формування компетенцій сучасного економіста, вона має теоретичне, методологічне і, водночас, прикладне значення для суб'єктів прийняття управлінських рішень з урахуванням наявних економічних умов та обмежень, за умов невизначеності, конфліктності та породженого ризику, вможливають передбачення наслідків рішень і заходів, що їх вживають у кожен поточний момент.</p>	
<b>3. Мета та цілі курсу</b>	
<p>Мета та цілі курсу полягають у формуванні в студентів цілісної системи знань щодо методології аналізу ризиків у підприємстві та управлінні, засвоєння студентами основних принципів та інструментарію щодо постановки задач, основних методів їх розв'язування та аналізу результатів із метою широкого використання в підприємстві та управлінні. Завдання які ставляться перед курсом полягають в наданні студентам теоретичних знань і розуміння основних положень курсу, як основи для набуття ними професійних умінь і навичок: на економічні процеси впливає низка керованих і некерованих чинників – ці процеси розвиваються за умов невизначеності та конфліктності, браку статистичних даних, необхідних на момент прийняття рішення, тобто за умов ризику; набуття знань про якісні властивості та кількісні характеристики економічних процесів з урахуванням ризику – характерного чинника сучасної економіки; вивчення низки найбільш типових прийомів моделювання та вимірювання економічного ризику у процесі прийняття рішень, опанування відповідним апаратом (методи, моделі, інформаційне забезпечення) з метою практичного використання в різноманітних економічних проблемах самостійно здійснювати аналіз ризику як на якісному, так і на кількісному рівні, оцінювати його ступінь, моделювати та враховувати його, керувати ризиком, управляти ризиком та ефективністю у відповідних сферах економічної діяльності, використовуючи новітні інформаційні технології розроблення методичних рекомендацій і завдань для самостійної роботи над вивченням курсу, що є засобом формування у студентів здібностей до проведення науково-практичних досліджень і презентації їх результатів.</p>	
<b>4. Результати навчання і компетентності</b>	
<b>Результати навчання:</b>	

ПРН 7. Демонструвати підприємливість в різних напрямках професійної діяльності та брати відповідальність за результати.

ПРН 17. Вміти вирішувати професійні завдання з організації діяльності підприємницьких, торговельних та біржових структур і розв'язувати проблеми у кризових ситуаціях з урахуванням зовнішніх та внутрішніх впливів.

ПРН 20. Знати основи бізнес-планування, оцінювання кон'юнктури ринків та результатів діяльності підприємницьких, торговельних і біржових структур з урахуванням ризиків.

#### **Компетентності**

ІК 1. Здатність розв'язувати складні спеціалізовані завдання та проблеми у сферах підприємницької, торговельної та біржової діяльності або в процесі навчання, що передбачає застосування певних теорій та методів відповідних наук і характеризується комплексністю та невизначеністю умов.

ЗК 10. Здатність діяти відповідально та свідомо.

СК 7. Здатність визначати і виконувати професійні завдання з організації діяльності підприємницьких, торговельних та біржових структур.

СК 10. Здатність до бізнес-планування, оцінювання кон'юнктури ринків і результатів діяльності у сфері підприємництва, торгівлі та біржової практики з урахуванням ризиків.

### **5. Організація навчання курсу**

Обсяг курсу - 90 год.

Вид заняття	Загальна кількість годин
Лекції	16
Практичні	16
самостійна робота	58

#### **Ознаки курсу**

Семестр	Спеціальність	Курс (рік навчання)	Нормативний / вибірковий
I	051 Економіка	другий	Вибірковий

#### **Тематика курсу**

Тема, план	Форма заняття	Література	Завдання, год	Вага оцінки	Термін виконання
Тема 1. Концептуальні засади ризиків в управлінні. предмет, мета та завдання дисципліни. ризик як економічна категорія. Ризик та невизначеність. Філософія системний аналіз ризику в економіці та підприємстві.	Лекція, практичне заняття	[1,2,3,6]	Опрацювати лекційний матеріал, підготуватися до практичного заняття	10 бали	До наступного заняття за розкладом
Тема 2. Основні концептуальні підходи якісного аналізу економічного ризику. Класифікація економічного ризику. Якісний аналіз ризику. Аспекти і фактори якісного аналізу ризику.	Лекція, практичне заняття	[1,2,3,6]	Опрацювати лекційний матеріал, підготуватися до практичного заняття	10 бали	До наступного заняття за розкладом
Тема 3. Нечітко-множинний аналіз ризику	Лекція, практичне	[3,4,5,6]	Опрацювати	10 бали	До наступного

основні поняття нечіткої логіки: Лінгвістичні змінні, функції приналежності множин. Теорія нечітких множин. логічні операції із нечіткими множинами. Нечітко- множинний аналіз ризику.	заняття		лекційний матеріал, підготуватися до практичного заняття, розв'язати задачі		заняття за розкладом
Тема 4. Імовірнісний інструментарій оцінювання ризику імовірнісний підхід до вибору раціонального рішення. Принцип Бернуллі-Лапласа. Критерій очікуваного результату. поняття дерева рішень. Принцип побудови. принцип зворотної індукції. Особливості застосування дерева рішень.	Лекція, практичне заняття	[1,6]	Опрацювати лекційний матеріал, Пройти тестування до теми	5 бали	До наступного заняття за розкладом
Тема 5. Методологічні засади та інструментарій кількісного оцінювання ступеня ризику аналіз концептуальних підходів щодо структури об'єктивного і суб'єктивного в оцінюванні ризику. Концептуальні засади кількісного аналізу ризику. Метод аналогій. аналіз чутливості (вразливості). Метод імітаційного моделювання. аналіз ризику збитків. Загальні підходи щодо кількісної оцінки ступеня ризику. Міра ризику як векторна величина. Кількісні показники ступеня ризику в абсолютному вираженні. Ризик у відносному вираженні. Граничні межі ризику.	Лекція, практичне заняття	[1,3,6]	Опрацювати лекційний матеріал, підготуватися до практичного заняття	5 бали	До наступного заняття за розкладом
Тема 6. Ризик та елементи теорії корисності концепція корисності.	Лекція, практичне заняття	[3,4,6]	Опрацювати лекційний	5 бали	До наступного заняття за

<p>Пріоритети та їх числове відображення. Поняття лотереї. Основні кількісні характеристики лотереї: сподівана корисність, детермінований еквівалент та премія за ризик.</p> <p>Ставлення до ризику суб'єктів господарювання та види функції корисності. Криві схильності-несхильності до ризику та криві байдужості.</p>			матеріал, підготуватися до практичного заняття		розкладом
<p>тема 7. Основні засади та методи управління економічним ризиком основні засади управління ризиком. Узагальнена блок-схема процесу управління ризиком. Зовнішні способи зниження ступеня ризику. Внутрішні способи зниження (оптимізації) ступеня ризику. Нові тенденції та інструментарій управління ефективністю та ризиком.</p>	Лекція, практичне заняття	[3,5,6]	Опрацювати лекційний матеріал, підготуватися до практичного заняття	5 балів	До наступного заняття за розкладом
<p>Тема 8. Основні засади та методи управління економічним ризиком основні засади управління ризиком. Узагальнена блок-схема процесу управління ризиком. Зовнішні способи зниження ступеня ризику. Внутрішні способи зниження (оптимізації) ступеня ризику. Нові тенденції та інструментарій управління ефективністю та ризиком.</p>	Лекція, практичне заняття	[3,5,6]	Опрацювати лекційний матеріал, підготуватися до практичного заняття	5 балів	До наступного заняття за розкладом
<p>Тема 9. Запаси та резерви як способи зниження ступеня ризику. Резервування грошових коштів на покриття випадкових затрат. Модель М.Міллера і Д.Орра у моделюванні</p>	Лекція, практичне заняття	[3,5,6]	Опрацювати лекційний матеріал, підготуватися до практичного заняття	5 балів	До наступного заняття за розкладом

коштів готівки. Принципи та інструментарій визначення раціонального рівня резервів у різних сферах економічної діяльності задачі управління виробництвом та резервами.			заняття		
<b>6. Система оцінювання курсу</b>					
Загальна система оцінювання курсу	<p><b>100 бална– 50 балів</b> протягом семестру та <b>50 балів</b> за екзамен</p> <p><b>“відмінно”</b> – студент демонструє повні і глибокі знання навчального матеріалу, достовірний рівень розвитку умінь та навичок, правильне й обґрунтоване формулювання практичних висновків, наводить повний обґрунтований розв’язок прикладів та задач, аналізує причинно-наслідкові зв’язки; вільно володіє науковими термінами;</p> <p><b>“добре”</b> – студент демонструє повні знання навчального матеріалу, але допускає незначні пропуски фактичного матеріалу, вміє застосувати його до розв’язання конкретних прикладів та задач, у деяких випадках нечітко формулює загалом правильні відповіді, допускає окремі несуттєві помилки та неточності розв’язках;</p> <p><b>“задовільно”</b> – студент володіє більшою частиною фактичного матеріалу, але викладає його не досить послідовно і логічно, допускає істотні пропуски у відповіді, не завжди вміє правильно застосувати набуті знання до розв’язання конкретних прикладів та задач, нечітко, а інколи й невірно формулює основні твердження та причинно-наслідкові зв’язки;</p> <p><b>“незадовільно”</b> – студент не володіє достатнім рівнем необхідних знань, умінь, навичок, науковими термінами.</p>				
Вимоги до письмової роботи	<p>Відповідно до навчального плану, студент виконує одну контрольну роботу, яка є допуском до складання іспиту. Головна мета її – перевірка самостійної роботи студентів в процесі навчання, виявлення ступеня засвоєння ними теоретичних положень курсу. При розв’язанні задач студент має детально вказувати, яким саме був хід його роздумів, якими формулами він користувався.</p>				
Семінарські заняття	<p>Практичне заняття проводиться з метою формування у студентів умінь і навичок з предмету, вирішення сформульованих завдань, їх перевірка та оцінювання.. За метою і структурою практичні заняття є ланцюжком, який пов’язує теоретичне навчання і навчальну практику з дисципліни, а також передбачає попередній контроль знань студентів. Оцінка за практичне заняття враховується при виставленні підсумкової оцінки з дисципліни</p>				
Умови допуску до підсумкового контролю	<ul style="list-style-type: none"> <li>– оцінка за поточне тестування (10 балів);</li> <li>– оцінка за відповіді на всі основні та додаткові запитання під час аудиторних занять (15 балів);</li> <li>– оцінка за контрольну роботу (15 балів);</li> </ul>				

	– оцінка за самостійну роботу (10 балів).
<b>7. Політика курсу</b>	
<p>- самостійне виконання навчальних завдань, завдань поточного та підсумкового контролю результатів навчання (для осіб з особливими освітніми потребами ця вимога застосовується з урахуванням їхніх індивідуальних потреб і можливостей);</p> <p>- посилення на джерела інформації у разі використання ідей, розробок, тверджень, відомостей;</p> <p>- надання достовірної інформації про результати власної навчальної (наукової, творчої) діяльності, використанні методики досліджень і джерела інформації».</p> <p>Засвоєння пропущеної теми лекції з поважної причини перевіряється під час складання підсумкового контролю. Пропуск лекції з неповажної причини відпрацьовується студентом відповідно вимог кафедри, що встановлені на засіданні кафедри (співбесіда, реферат тощо).</p> <p>Пропущені практичні, семінарські та лабораторні заняття, незалежно від причини пропуску, студент відпрацьовує згідно з графіком консультацій Поточні „2”, отримані студентом під час засвоєння відповідної теми на практичному, семінарському та лабораторному занятті перескладаються викладачеві, який веде заняття до складання підсумкового контролю з обов'язковою відміткою у журналі обліку роботи академічних груп.</p>	
<b>8. Рекомендована література</b>	
<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Верченко П.І., Великоіваненко Г.І., Демчук Н.В., Компаніченко О.С., Шатарська І.Ф. Ризикологія: Навч.-метод. посіб. для самост. вивч. дисц. – К.: КНЕУ, 2006. – 176 с.</li> <li>2. Вітлінський В.В., Великоіваненко Г.І. Ризикологія в економіці та підприємстві: Монографія. – К.: КНЕУ, 2004.</li> <li>3. Вітлінський В.В., Верченко П.І. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком: Навч.-метод. посібник для самост. вивч. дисц. – К.: КНЕУ, 2000. – 292 с.</li> <li>4. Економічний ризик: ігрові моделі: Навч. посібник / В.В. Вітлінський, П.І. Верченко, А.В. Сігал, Я.С. Наконечний; За ред. В.В. Вітлінського. – К.: КНЕУ, 2002. – 446 с.</li> <li>5. Вітлінський В.В. Аналіз, оцінка і моделювання економічного ризику. - К.: Деміур, 1996. - 212 с.</li> <li>6. Вітлінський В.В., Наконечний С.І. Ризик у менеджменті. - К.: ТОВ Борисфен-М, 1996. - 336 с.</li> <li>7. Вітлінський В.В., Наконечний С.І., Шарапов О.Д. Економічний ризик і методи його вимірювання: Підручник. - К.: ІЗМН, 1996. - 400 с.</li> <li>8. Вітлінський В.В., Білик Т.О., Великоіваненко Г.І., Волощук С.Д., Водзянова Н.К., Матвійчук А.В., Савіна С.С, Шатарська І.Ф. <i>Економіко-математичні методи і моделі. Практикум / Електронний ресурс</i> – К.: КНЕУ, 2014. – 221 с.</li> </ol>	

**Викладач**

**Стефінін В.В.**