



## Силабус курсу

### Управління ризиками в міжнародному бізнес-середовищі

Ступінь вищої освіти      бакалавр  
Галузь знань                07 «Управління та адміністрування»  
Спеціальність            073 «Менеджмент»  
Освітньо-професійна програма «Міжнародний менеджмент»

\*Рік навчання: 4, \*Семестр: I

\*Кількість кредитів: 5 Мова викладання: українська

#### Керівник курсу

ПІП

Старший викладач. ДФ Сохацький Олександр

Контактна інформація

s\_sokhatsky1993@ukr.net, +380980844676

#### Опис дисципліни

Метою дисципліни «Управління ризиками в міжнародному бізнес-середовищі» є отримання знань про природу та причини проявів ризиків на міжнародному бізнесі та отримати навичок щодо вирішення їх.

Завданнями вивчення навчальної дисципліни є:

- вивчення основ теорії ризиків, методики досліджень та оцінок ризиків, а також науково-методичних засад управління ризиками в сучасних умовах господарювання;
- засвоєння послідовності та змісту етапів управління ризиками в організації;
- оволодіння інструментарієм управління ризиками, які застосовуються у різних функціональних сферах;
- моделювання та прогнозування умов зменшення та (або) уникнення ризиків, їхнього впливу на діяльність підприємств (організації), галузі, регіону;
- оцінювати прояви ефективності, ризиків та наслідків очікуваних результатів впровадження інновацій;
- набуття практичних навичок розробки заходів з метою розв'язання актуальних управлінських проблем комерційної організації.

#### Структура курсу

Години (лек. / сем.)	Тема	Результати навчання	Завдання
4 / 2	Тема 1. Сутність ризику як економічної категорії	Сутність ризиків. Поняття ризику, його ймовірнісні характеристики. Суб'єкт та об'єкт ризику. Функції ризику. Причини виникнення ризиків в підприємстві. Взаємозв'язок понять «ризик» та «невизначеність». Психологічні передумови прийняття ризикових рішень.	Поточне опитування

2 / 2	Тема 2. Класифікація ризиків.	Класифікація ризиків. Ознаки класифікації та види ризиків. Системні та внутрішні ризики підприємства. Виробничі, транспортні, фінансові, інвестиційні, комерційні (маркетингові) ризики, ризики у соціально-трудових відносинах. Розмежування ризиків за економічними наслідками.	Поточне опитування
4 / 2	Тема 3 Організація управління ризиками. Поняття ризик-менеджменту.	Організація управління ризиками. Поняття ризик-менеджменту. Етапи процесу управління ризиком: збір інформації за аспектами ризику, якісний аналіз, методи кількісного оцінювання ризику, розробка заходів щодо оптимізації ризику, прийняття чи відхилення ризикового рішення. Правила управління ризиками.	Поточне опитування
4 / 2	Тема 4. Статистичні методи оцінювання ризиків.	Статистичні методи оцінювання ризиків. Дисперсійний метод оцінювання ризику, основні показники варіації. Імовірнісний метод оцінювання ризику. Визначення ймовірності досягнення бажаного результату за інтегральною функцією щільності розподілу ймовірностей. Метод $\beta$ -коефіцієнта оцінювання системного ризику проекту (бізнесу).	есе на тему
4 / 4	Тема 5. Якісні методи оцінювання ризиків.	Якісні методи оцінювання ризиків. Сутність та групування якісних методів оцінювання ризику. Метод мозкового штурму. Загальна характеристика експертних процедур, їх використання для розрахунку рівня ризику проекту. Перевірка узгодженості дій експертів на основі розрахунку коефіцієнта конкордації. Методи асоціацій та аналогій.	Поточне опитування
4 / 2	Тема 6. Матричні методи та критерії прийняття ризикових рішень в умовах невизначеності.	Матричні методи та критерії прийняття ризикових рішень в умовах невизначеності. Використання матриць в оцінюванні альтернативних рішень. Критерії прийняття рішень в умовах високої ентропії: максимінний критерій Вальда, мінімаксий критерій Севіджа, критерій недостатнього	Поточне опитування

		обґрунтування Лапласа, критерій узагальненого песимізму-оптимізму Гурвіца.	
4 / 2	Тема 7. Застосування теорії ігор в умовах ризику	Застосування теорії ігор в умовах ризику. Методологічні засади теорії ігор. Класифікація ігор. Чиста та змішана стратегії. Засоби розв'язання завдань теорії ігор. Оптимальна поведінка в умовах специфічних видів ризику.	Поточне опитування
2 / 2	Тема 8. Основні напрями впливу на ризик.	Основні напрями впливу на ризик. Методи уникнення ризику. Характеристика основних засобів регулювання ризику: резервування засобів, система вибору клієнтів, залучення зовнішніх джерел, здобуття додаткової інформації, диверсифікація, лімітування, біржове хеджування ризиків.	Поточне опитування
2 / 2	Тема 9. Страхування ризиків.	Страхування ризиків. Сутність страхування, суб'єкти та об'єкти страхування. Особисте, майнове страхування та страхування відповідальності. Критерії прийняття рішень щодо страхування ризиків. Страхування вантажів.	Круглий стіл
4 / 2	Тема 10. Регулювання та зниження ризиків.	Регулювання та зниження ризиків. Основні методи зниження ризиків та їх характеристика. Організаційні засоби та прийоми впливу на ризик. Економічні методи зниження ризику. Створення спеціального резервного фонду. Створення страхового товарного запасу. Страховий запас коштів. Розробка і впровадження системи штрафних санкцій. Страхування від ризику. Хеджування як метод зниження ризику. Розроблення заходів, які пом'якшують вплив ризикових ситуацій на діяльність підприємства. Вибір методу зниження ризиків.	Поточне опитування

4/2	Тема 11. Диверсифікація ризиків, її види та сфери застосування	Диверсифікація ризиків, її види та сфери застосування. Поняття диверсифікації, сутність політики диверсифікації підприємства, поняття кореляції активів. Причини диверсифікації підприємницької діяльності. Переваги та недоліки диверсифікації. Аналітичний, табличний та графічний методи визначення доцільності диверсифікації.	Поточне опитування
4/2	Тема 12. Оптимізація інвестиційних ризиків.	Оптимізація інвестиційних ризиків. Ризик інвестиційного портфеля. Принципи формування та оптимізація структури портфеля інвестицій. Критерії оцінки інвестиційних проектів. Вплив ризику та інфляції на величину очікуваної ставки відсотку (дисконту).	ректорська контрольна робота

### Літературні джерела

1. Transforming risk efficiency and effectiveness, 2019. URL: <https://www.mckinsey.com/business-functions/risk/our-insights/transforming-risk-efficiency-and-effectiveness>.
2. Gartner Says Coronavirus Exposes Outdated Risk Management Practices: web-site Gartner. URL: <https://www.gartner.com/en/newsroom/press-releases/2020-03-26-gartner-says-coronavirus-exposes-outdated-risk-management-practices>.
3. В. В. Дергачова, Ю. В. Рудніцька. управління ризиками зовнішньоекономічної діяльності в умовах пандемії covid-19
4. The financial risk management of the Eurosystem's monetary policy operations. European Central Bank. URL: [https://www.ecb.europa.eu/pub/conferences/shared/pdf/20180709\\_ecb\\_central\\_banking\\_seminar/2018-07-13\\_Mitigating\\_risks\\_in\\_the\\_Eurosystem-s\\_monetary\\_policy\\_operations\\_-\\_Mourato.pdf](https://www.ecb.europa.eu/pub/conferences/shared/pdf/20180709_ecb_central_banking_seminar/2018-07-13_Mitigating_risks_in_the_Eurosystem-s_monetary_policy_operations_-_Mourato.pdf)
5. Strategic Risk Management and Balance Sheet Management under the new regulatory environment/ Moody's Analytics. URL: <https://www.moodyanalytics.com/-/media/presentation/2012/2012-18-09-Strategic-Risk-Management-for-distribution-online.pdf>
6. Enterprise Risk Management: An Analytic Approach. URL: <https://www.irmi.com/docs/default-source/expert-commentary-documents/miccolis05a.pdf?sfvrsn=4>
7. Climate Financial Risk Forum guide 2020. Risk Management chapter. URL: <https://www.fca.org.uk/publication/corporate/climate-financial-risk-forum-guide-2020-disclosures-chapter.pdf>
8. Донець Л.І. (2018) Економічні ризики та методи їх вимірювання: навчальний посібник / Л.І. Донець. - К.: Центр навчальної літератури, 2018. - 312 с. - Режим доступу:

- [http://shron.chtyvo.org.ua/Donets\\_Liubov/Ekonomichni\\_ryzyky\\_ta\\_metody\\_yikh\\_vymiruvannia.pdf](http://shron.chtyvo.org.ua/Donets_Liubov/Ekonomichni_ryzyky_ta_metody_yikh_vymiruvannia.pdf) 3.
9. Павленко І, Мироненко О. Управління ризиками інноваційної діяльності підприємства. Київський національний університет технологій та дизайну. DOI: <https://doi.org/10.32839/2304-5809/2018-12-64-150>. С (666-670).
  10. Піщук Л.І. Микитюк Н.Є. (2018) Організація системи управління ризиками на промислових підприємствах. URL: <http://global-national.in.ua/archive/23-2018/58.pdf>
  11. Доценко І. О. Стратегія управління фінансовими ризиками підприємства в процесі формування його фінансової безпеки. Modern Economics. 2020. № 20(2020). С. 73-78. DOI: [https://doi.org/10.31521/modecon.V20\(2020\)-12](https://doi.org/10.31521/modecon.V20(2020)-12).
  12. Shyshkina O. & Zhurman S. (2018). Systematyzatsiia naukovykh pidkhodiv do rozuminnia pryrody ryzyku. [Systematization of scientific approaches to the rationalization of nature.]. Problems and perspectives of economy and management. No. 3 (15), pp. 155–163
  13. Вараксіна О. В Михатіло В. В. Інновації як важливий чинник забезпечення стійких конкурентних переваг. Вчені записки ТНУ імені В. І. Вернадського. Серія: Економіка і управління Том 31 (70). 2020. № 1, С.36–39. URL : [http://www.econ.vernadskyjournals.in.ua/journals/2020/31\\_70\\_1/8.pdf](http://www.econ.vernadskyjournals.in.ua/journals/2020/31_70_1/8.pdf).
  14. Вараксіна О. В., Золотих Я. Г., Гедерім К. О. Стратегічне управління підприємством як необхідна умова забезпечення продовольчої безпеки національної економіки. Інфраструктура ринку. Причорноморський науково-дослідний інститут економіки та інновацій. 2020. Випуск 40. С. 54–59. URL [http://www.marketinfr.od.ua/journals/2020/40\\_2020\\_ukr/11.pdf](http://www.marketinfr.od.ua/journals/2020/40_2020_ukr/11.pdf)
  15. Вараксіна О. В. Григорова С. В., Джерело конкурентної переваги: теоретичний аспект. Електронне наукове фахове видання. Східна Європа: економіка, бізнес та управління. 2020. № 4 (27).с. 54- 59 [http://www.market-infr.od.ua/journals/2020/40\\_2020\\_ukr/40\\_2020.pdf](http://www.market-infr.od.ua/journals/2020/40_2020_ukr/40_2020.pdf)
  16. Донець Л.І. Економічні ризики та методи їх вимірювання: навчальний посібник- К.: Центр навчальної літератури, 2018. 312 с. URL : [http://shron.chtyvo.org.ua/Donets\\_Liubov/Ekonomichni\\_ryzyky\\_ta\\_metody\\_yikh\\_vymiruvannia.p d](http://shron.chtyvo.org.ua/Donets_Liubov/Ekonomichni_ryzyky_ta_metody_yikh_vymiruvannia.pdf)
  17. Герасименко О.М. Ризик-орієнтований підхід до управління: ідентифікація ризиків підприємства залізничного транспорту. Вісник Черкаського університету. Серія «Економічні науки». 2019. № 2. С. 13-19.
  18. Герасименко О.М. Ідентифікація ключових ризиків в діяльності підприємства з вироблення солоду: джерела ризику, ризикові події, заходи контролю. Вісник Черкаського університету. Серія «Економічні науки». 2019. № 3. С. 134-139.
  19. Черненко Н.М. Методичні рекомендації Методичні рекомендації для вивчення дисципліни «Основи управління ризиками у закладах освіти». 2020. 44 с.
  20. Мороз В.В., Клиновий Д.В. Фінансова-правова складова євроінтеграційного механізму управління природними ресурсами в публічній сфері. Збірник наукових праць Національної академії державного управління при Президентіві України. 2018. Вип. 1. С. 61-84.

#### Політика оцінювання

**Політика щодо дедлайнів та перескладання:** Для виконання індивідуальних завдань і проведення контрольних заходів встановлюються конкретні терміни. Перескладання модулів відбувається з дозволу дирекції факультету (інституту) за наявності поважних причин (наприклад, лікарняний).

**Політика щодо академічної доброчесності:** Письмові роботи підлягають перевірці на наявність плагіату та допускаються до захисту з коректними текстовими запозиченнями. Використання друкованих і електронних джерел інформації під час контрольних заходів та екзаменів заборонено.

**Політика щодо відвідування:** Відвідування занять є обов'язковим компонентом оцінювання. За об'єктивних причин (наприклад, карантин, воєнний стан, хвороба, закордонне стажування) навчання може відбуватись в онлайн формі за погодженням із керівником курсу.

#### Оцінювання

Заліковий модуль 1	Заліковий модуль 2	Заліковий модуль 3	Заліковий модуль 4
20%	20%	20%	40%
1. Опитування (тестування) на заняттях: 6 тем по 5 балів – мах 30 балів 2. письмова робота – мах 70 балів	1. Опитування (тестування) на заняттях: 6 тем по 5 балів – мах 30 балів 2. письмова робота – мах 70 балів	1. Підготовка КПІЗ – мах 30 балів 2. захист КПІЗ – мах 30 балів 3. Участь у тренінгах мах 40 балів	1. тестові завдання (5 тестів по балам) – мах 25 балам 2. теоретичне питання – мах 25 3. задача 50 балів.

#### Шкала оцінювання:

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)