

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
 Чорноморський національний університет імені Петра Могили
 Факультет економічних наук
 Кафедра економіки та підприємництва

“ЗАТВЕРДЖУЮ”

Перший проректор

Іщенко Н.М.



“28” 08 2020 року

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ
« УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ ПІДПРИЄМСТВА »

Спеціальність 076 «Підприємництво, торгівля та біржова діяльність»

Освітня програма «Економіка та управління підприємством»

Рівень вищої освіти – другий (магістерський)

Розробник

Кузьменко О.Б.

Лопатін А.О.

Завідувач кафедри економіки та підприємництва

Кузьменко О.Б.

Гарант освітньої програми

Кузьменко О.Б.

В.о. декана факультету економічних наук

Філімонова О.Б.

Директор ННЦ ІПДО

Норд Г.Л.

Начальник НМВ

Шкірчак С.І.



Миколаїв – 2020 рік

1. Опис навчальної дисципліни

Найменування показника	Характеристика дисципліни	
Найменування дисципліни	Управління ризиками підприємства	
Галузь знань	07 Управління та адміністрування	
Спеціальність	076 Підприємництво, торгівля та біржова діяльність	
Спеціалізація (якщо є)	-	
Освітня програма	Економіка та управління підприємством	
Рівень вищої освіти	Другий (магістерський)	
Статус дисципліни	Вибіркова	
Курс навчання	5	
Навчальний рік	2019-2020	
Номер(и) семестрів (триместрів):	Денна форма	Заочна форма
	10	15, 16
Загальна кількість кредитів ЄКТС/годин	5 кредитів / 150 годин	
Структура курсу: – лекції – практичні заняття – годин самостійної роботи студентів	Денна форма	Заочна форма
	18	8
	36	8
	96	134
Відсоток аудиторного навантаження	36%	11%
Мова викладання	Українська	
Форма проміжного контролю (якщо є)	-	
Форма підсумкового контролю	Іспит	

2. Мета, завдання та результати вивчення дисципліни

Метою дисципліни «Управління ризиками підприємства» є набуття студентами теоретичних знань щодо ризиків підприємства та отримання практичних навичок реалізації заходів щодо їх зниження. Вивчення дисципліни передбачає формування теоретичних знань та практичних навичок у системі оцінки ступеня ризику підприємства та вибору оптимальних інструментів для його зниження до мінімально можливого рівня.

Завдання дисципліни:

- вивченні теоретичних основ ризиків підприємства;
- оволодіння методиками обробки інформації для оцінки ступеня ризику підприємства;
- оволодінні навиками об'єктивного розуміння результатів управління ризиками підприємства;
- формування критичного мислення при аналізі взаємозв'язків явищ і процесів різних рівнів діяльності підприємства і функціонування виробничої системи, прогнозування їх розвитку.

Передумови вивчення дисципліни: Вища математика, Економіка та організація торгівлі, Технології продажів.

Очікувані результати навчання: виявляти навички пошуку, збирання та аналізу інформації для оцінки ризику підприємства; розрахунку показників для

обґрунтування управлінських рішень в умовах ризику; застосовувати методи зниження ступеня ризику; демонструвати навички самостійної роботи, гнучкого мислення, відкритості до нових знань, бути критичним і самокритичним.

В результаті вивчення дисципліни студент

має знати:

- теоретичні основи ризиків підприємства (сутність, види, класифікацію);
- інструменти, які дозволяють знизити ступінь ризику виробничої діяльності;
- особливості застосування інструментів хеджування ризику при різних видах господарської діяльності;

має вміти:

- обирати найбільш ефективні інструменти хеджування ризиків підприємства;
- оцінювати ризики для прийняття рішень щодо реалізації заходів по управлінню ними;
- розробляти стратегію управління підприємством, що зменшує ступінь ризику;
- страхувати активи, перерозподіляти капіталовкладення між активами, управляти запасами для зниження ризику.

Програмні компетенції

загальні компетентності:

ЗК1. Здатність до адаптації та дії в новій ситуації.

ЗК 2. Вміння виявляти, ставити та вирішувати проблеми.

ЗК4. Здатність спілкуватися з представниками інших професійних груп різного рівня (з експертами з інших галузей знань/видів економічної діяльності).

спеціальні (фахові, предметні) компетентності

СК1. Здатність розробляти та реалізовувати стратегію розвитку підприємницьких, торговельних та/або біржових структур.

СК 3. Здатність до ефективного управління діяльністю суб'єктів господарювання в сфері підприємництва, торгівлі та/або біржової діяльності.

СК4. Здатність до вирішення проблемних питань і прийняття управлінських рішень у професійній діяльності.

СК5. Здатність до ініціювання та реалізації інноваційних проектів в підприємницькій, торговельній та/або біржовій діяльності.

СК6. Здатність до вирішення проблемних завдань і прийняття рішень у сфері управління фінансово-економічними результатами і ризиками діяльності підприємства

Програмні результати навчання:

РН1. Вміти адаптуватися та проявляти ініціативу і самостійність в ситуаціях, які виникають в професійній діяльності.

РН 2. Визначати, аналізувати проблеми підприємництва, торгівлі і біржової діяльності та розробляти заходи щодо їх вирішення.

РН4. Застосовувати бізнес-комунікації для підтримки взаємодії з представниками різних професійних груп.

PH 6. Визначати та впроваджувати стратегічні плани розвитку суб'єктів господарювання у сфері підприємництва, торгівлі та/або біржової діяльності.

PH 8. Розробляти і приймати рішення, спрямовані на забезпечення ефективності діяльності суб'єктів господарювання у сфері підприємницької, торговельної та/або біржової діяльності.

PH9. Вміти вирішувати проблемні питання, що виникають в діяльності підприємницьких, торговельних та/або біржових структур за умов невизначеності та ризиків.

PH10. Впроваджувати інноваційні проекти з метою створення умов для ефективного функціонування та розвитку підприємницьких, торговельних та/або біржових структур.

PH11. Вміти розробляти і впроваджувати проекти для виконання управлінських рішень щодо фінансово-економічних результатів і ризиків діяльності підприємства.

3. Програма навчальної дисципліни

Денна форма:

	Теми	Лекції	Практичні	Самостійна робота
1	Тема 1. Ризики підприємства – сутність, види, класифікація	2	4	10
2	Тема 2. Аналіз і оцінка ризиків підприємства.	2	4	12
3	Тема 3. Управління ризиками підприємства.	2	4	10
4	Тема 4. Транспортні ризики та їх хеджування	2	4	10
5	Тема 5. Вибір оптимальної стратегії в умовах ризику в конфліктній ситуації	2	4	10
6	Тема 6. Вибір оптимальної стратегії в умовах ризику пов'язаного з невизначеністю ринкового середовища	2	4	10
7	Тема 7. Страхування ризиків підприємства.	2	4	12
8	Тема 8. Диверсифікація як спосіб зниження ризику підприємства.	2	4	10
9	Тема 9. Управління запасами як спосіб зниження ризику	2	4	12
	Всього за курсом	18	36	96

Заочна форма:

	Теми	Лекції	Практичні	Самостійна робота
--	------	--------	-----------	-------------------

1	Тема 1. Ризики підприємства – сутність, види, класифікація	1	1	14
2	Тема 2. Аналіз і оцінка ризиків підприємства.	1	1	14
3	Тема 3. Управління ризиками підприємства.	1	1	16
4	Тема 4. Транспортні ризики та їх хеджування	1	1	17
5	Тема 5. Вибір оптимальної стратегії в умовах ризику в конфліктній ситуації	1	1	14
6	Тема 6. Вибір оптимальної стратегії в умовах ризику пов'язаного з невизначеністю ринкового середовища	1	1	16
7	Тема 7. Страхування ризиків підприємства.	1	1	14
8	Тема 8. Диверсифікація як спосіб зниження ризику підприємства.	0,5	0,5	14,5
9	Тема 9. Управління запасами як спосіб зниження ризику	0,5	0,5	14,5
	Всього за курсом	8	8	134

4. Зміст навчальної дисципліни

Денна форма

4.1. План лекцій

№	Тема заняття / план
1	Тема 1. Ризики підприємства – сутність, види, класифікація 1) Актуальність вивчення, сутність ризиків підприємства.. Причини їх виникнення. 2) Основні види та класифікація ризиків підприємства. 3) Особливості різних видів ризиків підприємства.
2	Тема 2. Аналіз і оцінка ризиків підприємства. 1) Якісний аналіз ризиків підприємства.. 2) Кількісний аналіз ризиків підприємства. 3) Система кількісних оцінок ступеня ризиків підприємства.
3	Тема 3. Управління ризиками підприємства. 1) Основні принципи управління ризиками підприємства. 2) Блок-схема процесу управління ризиками підприємства. 3) Зовнішні і внутрішні способи зниження ризику.
4	Тема 4. Транспортні ризики та їх хеджування 1) Класифікація транспортних ризиків за Міжнародною торгівельною палатою. 2) Перерозподіл транспортного ризику між продавцем і покупцем товару.
5	Тема 5. Вибір оптимальної стратегії в умовах ризику при конфлікті інтересів 1) Формалізація конфлікту інтересів покупця і продавця за допомогою теорії ігор. 2) Методи вибору оптимальних стратегій.
6	Тема 6. Вибір оптимальної стратегії в умовах ризику пов'язаного з невизначеністю ринкового середовища 1) Формалізація ризику пов'язаного з невизначеністю ринкового середовища за

	<p>допомогою гри з природою.</p> <p>2) Критерії прийняття рішень при грі з природою.</p> <p>3) Дерево рішень.</p>
7	<p>Тема 7. Страхування ризиків підприємства.</p> <p>1) Страхові випадки ризиків підприємства.</p> <p>2) Механізм відшкодування збитків при страхуванні ризиків підприємства.</p>
8	<p>Тема 8. Диверсифікація як спосіб зниження ризику підприємства</p> <p>1) Диверсифікація господарської діяльності – сутність, види і правила.</p> <p>2) Кореляція між нормами прибутку різних товарів та її застосування.</p>
9	<p>Тема 9. Управління запасами як спосіб зниження ризику підприємства</p> <p>1) Обсяг резерву сировини і матеріалів для безперебійного забезпечення виробництва.</p> <p>2) Резервування грошових засобів для покриття випадкових затрат.</p> <p>3) Модель М.Міллера і Д.Орра.</p> <p>4) Модель формування оптимального резерву.</p>

4.2. План практичних занять

№	Тема заняття / план
1	<p>Тема 1. Ризики підприємства – сутність, види, класифікація</p> <p>1) Розглянути актуальність вивчення, сутність ризиків підприємства. Причини їх виникнення.</p> <p>2) Розглянути основні види та класифікацію ризиків підприємства.</p>
2	<p>Тема 1. Ризики підприємства – сутність, види, класифікація</p> <p>1) Проаналізувати особливості різних видів ризиків підприємства.</p> <p>2) Провести тестове опитування по темі.</p>
3	<p>Тема 2. Аналіз і оцінка ризиків підприємства</p> <p>1) Зробити якісний аналіз ризиків підприємства при різних видах господарської діяльності.</p> <p>2) Провести тестове опитування по темі.</p>
4	<p>Тема 2. Аналіз і оцінка ризиків підприємства</p> <p>1) Розглянути систему кількісних оцінок ступеня ризиків підприємства.</p> <p>2) Розв'язування задач на кількісний аналіз ризиків підприємства.</p>
5	<p>Тема 3. Управління ризиками підприємства</p> <p>1) Розглянути основні принципи управління ризиками підприємства.</p> <p>2) Проаналізувати блок-схему процесу управління ризиками підприємства.</p>
6	<p>Тема 3. Управління ризиками підприємства</p> <p>1) Розглянути застосування зовнішніх способів зниження ризиків підприємства.</p> <p>2) Розглянути застосування внутрішніх способів зниження ризиків підприємства.</p>
7	<p>Тема 4. Транспортні ризики та їх хеджування</p> <p>1) Розглянути класифікацію транспортних ризиків за Міжнародною торгівельною палатою та ІНКОТЕРМС.</p> <p>2) Провести тестове опитування по темі.</p>
8	<p>Тема 4. Транспортні ризики та їх хеджування</p> <p>1) Аналіз конкретних ситуацій перерозподілу транспортного ризику між продавцем і покупцем товару.</p> <p>2) Провести тестове опитування по темі.</p>
9	<p>Тема 5. Вибір оптимальної стратегії в умовах ризику в конфліктній ситуації</p> <p>1) Розглянути теорію ігор в моделюванні ризиків підприємства.</p> <p>2) Розв'язування задач на вибір оптимальної стратегії в стратегічних іграх.</p>
10	<p>Тема 5. Вибір оптимальної стратегії в умовах ризику в конфліктній ситуації</p> <p>1) Розглянути методи вибору оптимальних стратегій.</p>

	2) Розв'язування задач в змішаних стратегіях та при мажорируванні стратегій.
11	Тема 6. Вибір оптимальної стратегії в умовах ризику пов'язаного з невизначеністю ринкового середовища 1) Розглянути моделювання ризику за допомогою гри з природою. 2) Розв'язування задач на вибір оптимальної стратегії в грі з природою.
12	Тема 6. Вибір оптимальної стратегії в умовах ризику пов'язаного з невизначеністю ринкового середовища 1) Розглянути критерії прийняття рішень в моделях гри з природою. 2) Розв'язування задач на вибір стратегії в грі з природою за допомогою критеріїв прийняття рішень..
13	Тема 7. Страхування ризиків підприємства 1) Розглянути страхові випадки ризиків підприємства. 2) Провести тестове опитування по темі.
14	Тема 7. Страхування ризиків підприємства. 1) Проаналізувати механізм відшкодування збитків при страхуванні ризиків. 2) Розв'язування задач на визначення розміру відшкодування збитків при страхуванні ризиків.
15	Тема 8. Диверсифікація як спосіб зниження ризиків підприємства 1) Розглянути диверсифікацію господарської діяльності підприємства – сутність, види і правила. 2) Провести тестове опитування по темі.
16	Тема 8. Диверсифікація як спосіб зниження ризиків підприємства 1) Розглянути кореляцію між нормами прибутку при реалізації різних товарів. 2) Розв'язування задач на визначення кореляції та оптимального асортименту товарів підприємства.
17	Тема 9. Управління запасами як спосіб зниження ризику підприємства 1) Розв'язування задач по визначенню обсягу резерву сировини та матеріалів для безперебійного забезпечення виробництва. 2) Розв'язування задач по визначенню резерву грошових засобів для покриття випадкових затрат.
18	Тема 9. Управління запасами як спосіб зниження ризику підприємства 1) Розв'язування задач за допомогою моделі М.Міллера і Д.Орра. 2) Розв'язування задач за допомогою моделі формування оптимального резерву.

Заочна форма

4.3. План лекцій

№	Тема заняття / план
1	Тема 1, 2 Ризики підприємства – сутність, види, класифікація, аналіз та оцінка 1) Актуальність вивчення, сутність ризиків підприємства. Причини їх виникнення. 2) Основні види та класифікація ризиків підприємства. 3) Якісний і кількісний аналіз ризиків підприємства. 4) Система кількісних оцінок ступеня ризиків підприємства.
2	Тема 3, 4 Управління ризиками підприємства. Транспортні ризики та їх хеджування 1) Основні принципи управління ризиками підприємства. 2) Блок-схема процесу управління ризиками підприємства. 3) Зовнішні і внутрішні способи зниження ризиків підприємства. 4) Класифікація транспортних ризиків за Міжнародною торгівельною палатою та перерозподіл транспортного ризику згідно неї.

3	<p>Тема 5, 6 Вибір оптимальної стратегії в умовах ризику в конфліктній ситуації та пов'язаного з невизначеністю ринкового середовища</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) Формалізація конфлікту інтересів покупця і продавця за допомогою теорії ігор. 2) Вибір оптимальних рішень у стратегічних іграх і у грі з природою. 3) Критерії прийняття рішень при грі з природою. 4) Дерево рішень.
4	<p>Тема 7, 8, 9 Страхування ризиків підприємства. Диверсифікація та управління запасами як способи зниження ризиків підприємства.</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) Страхові випадки ризиків підприємства та відшкодування збитків при їх настанні. 2) Диверсифікація господарської діяльності – сутність, види і правила. 3) Кореляція між нормами прибутку різних товарів та її застосування. 4) Обсяг резерву сировини і матеріалів для безперебійного забезпечення виробництва. 5) Резервування грошових засобів для покриття випадкових затрат. Модель М.Міллера і Д.Орра.

4.4. План практичних занять

№	Тема заняття / план
1	<p>Тема 1, 2 Ризики підприємства – сутність, види, класифікація, аналіз та оцінка</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) Розглянути актуальність вивчення, сутність ризиків підприємства. Причини їх виникнення. 2) Розглянути основні види та класифікацію ризиків підприємства. 3) Зробити якісний і кількісний аналіз ризиків підприємства при різних видах господарської діяльності. 4) Розв'язування задач на кількісний аналіз ризиків підприємства. 5) Провести тестове опитування по темі.
2	<p>Тема 3,4 Управління ризиками підприємства. Транспортні ризики та їх хеджування</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) Розглянути основні принципи управління ризиками підприємства. 2) Проаналізувати блок-схему процесу управління ризиками підприємства. 3) Розглянути застосування зовнішніх і внутрішніх способів зниження ризику підприємства. 4) Розглянути класифікацію транспортних ризиків за Міжнародною торгівельною палатою. 5) Аналіз конкретних ситуацій перерозподілу транспортного ризику між продавцем і покупцем товару. 6) Провести тестове опитування по темі.
3	<p>Тема 5, 6 Вибір оптимальної стратегії в умовах ризику в конфліктній ситуації та пов'язаного з невизначеністю ринкового середовища</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) Розглянути теорію ігор в моделюванні ризиків підприємства. 2) Розглянути методи вибору оптимальних стратегій. 3) Розв'язування задач за умов стратегічних ігор, в змішаних стратегіях та при мажорируванні стратегій. 4) Розв'язування задач на вибір оптимальної стратегії в грі з природою. 5) Розглянути критерії прийняття рішень в моделях гри з природою. 6) Розв'язування задач на вибір стратегії в грі з природою за допомогою критеріїв прийняття рішень. 7) Провести тестове опитування по темі.
4	<p>Тема 7, 8, 9 Страхування ризиків підприємства. Диверсифікація та управління запасами як способи зниження ризиків підприємства.</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) Розглянути страхові випадки ризиків підприємства. 2) Розв'язування задач на визначення розміру відшкодування збитків при страхуванні

ризиків підприємства.

- 3) Розглянути диверсифікацію господарської діяльності – сутність, види і правила.
- 4) Розглянути кореляцію між нормами прибутку при реалізації різних товарів.
- 5) Розв'язування задач на визначення кореляції та оптимального асортименту товарів.
- 6) Розв'язування задач по визначенню обсягу резерву сировини та матеріалів для безперервного забезпечення виробництва.
- 7) Розв'язування задач за допомогою моделі М.Міллера і Д.Орра.
- 8) Провести тестове опитування по темі.

4.5. Завдання для самостійної роботи

Завдання для аналітичної роботи (денна форма), контрольної роботи (заочна форма) з дисципліни «Управління ризиками підприємства»

Аналітична робота з дисципліни – є видом поза аудиторної самостійної роботи студента навчального, навчально-дослідного чи проектно-конструкторського характеру, що виконується на основі самостійного вивчення частини програмового матеріалу або його систематизації та узагальнення, для практичного застосування.

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

Зміст. Аналітична робота – це завершена теоретико-практична робота в межах навчальної програми курсу «Управління ризиками підприємства», яка виконується на основі знань, умінь і навичок, одержаних в процесі лекційних, семінарських, практичних занять, охоплює декілька тем або зміст навчального курсу в цілому.

Вибір та затвердження теми

Важливим елементом у написанні аналітичної роботи є вибір теми, тобто проблеми дослідження. Слід пам'ятати, що від правильного обрання теми та складеного плану залежить якість виконання роботи.

Тематика аналітичної роботи розробляється на кафедрі економіки та підприємництва ЧНУ ім. Петра Могили, відповідно до навчального плану з дисципліни «Управління ризиками підприємства», навчальним планом якої передбачено виконання такого виду самостійної роботи. Студенти беруть тему аналітичної роботи за номером у списку групи у переліку тем. Вони також можуть самі запропонувати тему роботи, виходячи з її актуальності, відповідності фахові, зі своїх практичних інтересів та сучасного стану розвитку досліджень, визначальних для обраної проблеми.

При розробці і виборі тем аналітичної роботи з дисципліни «Управління ризиками підприємства», мають враховуватися особливості сучасної діяльності студента.

Після вибору теми студент звертається до викладача за її затвердженням. Дуже важливо, коли він сам перед тим спробує розробити план своєї теми, добре обміркує і чітко уявить собі хід її виконання, враховуючи конкретні умови, в яких йому доведеться працювати. Це дасть можливість керівникові зважити і

врахувати здібності студента, його підготовленість до виконання даної роботи, а отже, зробити правильні висновки про те, яку надати йому допомогу саме там, де вона найбільш необхідна.

Аналітична робота має теоретичний, аналітичний та практичний характер. Вона пишеться на основі аналізу й узагальнення низки літературних джерел: монографій, брошур, статей, методичних рекомендацій і т. ін. Студент повинен зв'язано, грамотно і логічно обґрунтувати обрану тему, взяти з літератури основний матеріал, який стосується проблеми, що вивчається, дати оцінку вивченим роботам, висловити свою точку зору, зробити висновки.

Слід зауважити, що до студентських аналітичних робіт висувається низка вимог. Основні з них такі:

- актуальність тематики, відповідність її сучасному стану певної галузі;
- вивчення та критичний аналіз наукової і періодичної літератури з теми;
- вивчення та характеристику історії досліджуваної проблеми та її практичного стану, а також передового (при наявності - й власного) досвіду;
- наявність чіткої характеристики об'єкта, предмета, мети і завдань, методів дослідження, опис та аналіз проведених автором емпіричних досліджень;
- узагальнення результатів, обґрунтування їх, висновки та практичні рекомендації.

Під час написання аналітичної роботи студент має звертатися до викладача за консультаціями, які здійснюються за графіком індивідуально-консультативної роботи.

Аналітична робота передбачає опрацювання літератури за певною темою, яка закріплюється за студентом викладачем на 1-му груповому занятті та має таку структуру:

- вступ
- основна частина
- висновки
- список використаної літератури та інформаційних джерел.

Аналітична робота виконується в електронному виді і висилається на Moodle
Оформлення аналітичної роботи

Індивідуальна робота подається викладачу ретельно відредагованою і чітко віддрукованою на папері формату А4 (210x297 мм):

- текстовий редактор – WORD;
- шрифт — Times New Roman;
- розмір шрифту — 14 кегель;
- накреслення – звичайний;
- інтервал між рядками — полуторний;
- абзац - 5мм;
- розташування тексту роботи – вирівнювання по ширині;
- кількість символів у рядку – не менше 60;
- кількість рядків на сторінці – до 30;
- нумерація сторінок — з права верхнього поля;
- вступ, висновки, список літератури не нумерують.

– поля:

Формули, таблиці, ілюстрації нумерують послідовно в межах кожного розділу. Номер їх складається з номеру розділу і порядкового номеру таблиці (формули, ілюстрації). Наприклад: 2.2 – друга таблиця другого розділу.

Таблицю вміщують після першого згадування про неї в тексті. Над правим верхнім кутом таблиці пишуть слово «Таблиця» і вказують її номер (знак № при цьому не пишуть). Примітки до таблиці розміщують безпосередньо під таблицею. Повторні посилання на таблицю дають по формі: (див. табл. 2).

Номер формули пишуть на її рівні біля правого поля аркуша. Стовпчик пояснень до формули (експлікацію) рівняють відносно знаку тире. Значення кожного символу і числового коефіцієнта подають з нового рядка. Вище та нижче кожної формули залишають не менше одного вільного рядка.

Посилання на джерела. Аналітичну роботу пишуть як літературний огляд. Під час підготовки аналітичної роботи студент має використовувати додаткові літературні джерела: матеріали періодичних економічних видань, статистичні та аналітичні матеріали, офіційні інтернет-сторінки органів влади. Текст аналітичної роботи повинен відображати посилання на використані джерела. Посилання на джерела цитат, фактичних і статистичних даних, точки зору авторів потрібні для того, щоб можна було перевірити їх достовірність. Якщо в аналітичній роботі відсутні посилання на джерела, то вважається, що воно написане на базі одного джерела. Така робота не зараховується.

Форма посилань на джерела може бути різною. Але обов'язково посилання на джерело крім прізвища автора, назви роботи повинно мати вихідні дані, номер сторінки з тим, щоб джерело можна було легко знайти і перевірити посилання на нього.

Джерела можна розміщувати в списку в порядку появи посилань у тексті, або в алфавітному порядку прізвищ перших авторів або заголовків.

У вступі (1-2 сторінки тексту) обґрунтовують актуальність теми, мету роботи, її структуру.

Основна частина складається з теоретичної, аналітичної і рекомендаційної частин. В теоретичній частині наводяться теоретичні засади управління комерційними ризиками, робиться огляд літературних джерел; в аналітичній частині висвітлюється фактичний стан певного виду господарської діяльності і ризики пов'язані з нею, проблеми управління ризиками, вітчизняний та/або зарубіжний досвід їх вирішення, роль держави (хто здійснює регулювання (суб'єкти регулювання), яким чином (методи регулювання)); рекомендаційна частина вміщає конкретні пропозиції, щодо покращення управління ризиками підприємства.

Висновки узагальнюють результати теоретичної, аналітичної і рекомендаційної частин.

Максимальний обсяг аналітичної роботи - до 20-25 сторінок разом з таблицями, графічним матеріалом, додатками та списком використаної літератури.

Тематика аналітичних (контрольних) робіт

1. Управління ризиками підприємства.
2. Ризик зовнішньо-торгівельної діяльності підприємства.
3. Метод аналогів для кількісної оцінки ризиків підприємства.
4. Метод аналізу чутливості для виявлення основних чинників ризику.
5. Основні види та класифікація ризиків підприємства.
6. Особливості застосування заходів для зменшення ризиків підприємства.
7. Ризик-менеджмент у діяльності підприємства.
8. Інкотермс – міжнародні правила поставки товарів на іноземних ринках.
9. Страхування ризиків підприємства в міжнародній практиці.
10. Основні ризики в електронній комерції
11. Диверсифікація господарської діяльності підприємства.
12. Використання експертних методів для оцінки ризиків підприємства.
13. Аналіз законодавчо-номативної бази України щодо ризику підприємства.
14. Аналіз комерційного ризику при міжнародній торгівлі.
15. Історія розвитку методів оптимізації рівня ризику підприємства.
16. Управління стратегією захисту від валютних ризиків.
17. Статистичний метод для кількісної оцінки ризику підприємства.
18. Моделі прогнозування валютних курсів та валютного ризику.
19. Методи антикризового управління компанією та роль резервів і запасів у цьому .
20. Моделювання резервів у зовнішньоекономічній діяльності.
21. Валютні резерви як спосіб зниження ризиків та методи їх моделювання.
22. Запаси та резерви, пов'язані з проблемами зниження ступеня ризику у підприємстві.

Забезпечення освітнього процесу

Вимагає використання мультимедійного забезпечення, зокрема, проектора на практичних заняттях (з окремих тем), wi-fi та програмного забезпечення як то Word, Excel, PowerPoint.

5. Підсумковий контроль

Питання до іспиту

1. Ризики підприємства – сутність і природа.
2. Причини виникнення ризиків підприємства.
3. Необхідність врахування дії ризику під час прийняття управлінських рішень.
4. Основні види ризиків підприємства.
5. Класифікація ризиків підприємства.
6. Особливості виникнення та дії різних видів ризиків підприємства.
7. Поняття невизначеності в господарській діяльності. Зв'язок невизначеності та ризику.
8. Невизначеність та її види.
9. Якісний аналіз ризиків підприємства: сутність, алгоритм, цілі.
10. Методи кількісного аналізу ризиків підприємства.

11. Поняття допустимого, критичного і катастрофічного ризику.
12. Чинники впливу на ступінь ризику господарської діяльності.
13. Показники кількісної оцінки ризиків підприємства.
14. Статистичний метод оцінки ступеня ризику.
15. Метод аналогів.
16. Експертні методи оцінки ризиків.
17. Метод аналізу чутливості.
18. Метод аналізу доцільності витрат.
19. Комплексна оцінка ризиків.
20. Оцінка ризиків на основі аналізу точки беззбитковості.
21. Оцінка ризику в абсолютному вираженні.
22. Оцінка ризику в відносному вираженні.
23. Необхідність управління ризиком у спектрі економічних проблем.
24. Загальні підходи до процесу управління ризиками підприємства.
25. Методи управління ризиком: уникнення ризику; попередження (запобігання) виникнення ризику; прийняття ризику; зниження ступеня ризику.
26. Основні принципи управління ризиками підприємства.
27. Узагальнена блок-схема управління ризиками підприємства.
28. Зовнішні способи оптимізації ступеня ризику підприємства.
29. Внутрішні способи оптимізації ступеня ризику підприємства.
30. Класифікація транспортних ризиків за Міжнародною торговельною палатою.
31. Перерозподіл відповідальності за товар згідно класифікації транспортних ризиків.
32. Основні поняття теорії ігор.
33. Стратегії гравців 1 та 2.
34. Оптимальні, чисті та змішані стратегії.
35. Мажорирування стратегій.
36. Модель гри з природою.
37. Матриця ризиків.
38. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності та ризику (максімакса, Вальда, Севіджа, Гурвіца, Байєса).
39. Модель дерева рішень.
40. Страхові випадки ризиків підприємства.
41. Види страхування які покривають ризики підприємства.
42. Механізм відшкодування збитків при страхуванні ризиків підприємства.
43. Диверсифікація господарської діяльності, сутність і види.
44. Основні правила диверсифікації.
45. Кореляція між нормами прибутку різних товарів та її застосування.
46. Структура та види резервів та запасів на непередбачувані затрати.
47. Резервування грошових засобів на покриття непередбачуваних затрат.
48. Управління запасами з урахуванням ризику.
49. Модель М. Міллера і Д. Орра.
50. Модель формування оптимального резерву.

Приклад типового білету на іспит Типові тести для відповіді

1. Розподіліть фактори ризику за джерелами:

Джерела:

- А- об'єктивні
- Б- суб'єктивні

Фактори:

- а) рівень продуктивності праці;
- б) інфляція;
- в) конкуренція;
- г) технічна та виробнича політика;
- д) екологія;
- е) рівень керування.

2. Кількісні методи аналізу ризиків (чотири вірних відповіді).

- А) фінансовий;
- Б) статистичний;
- В) аналогів;
- Г) економічний;
- Д) експертний;
- Е) перевірочний;
- Є) доречності витрат.

Типові задачі для розв'язування

Задача 1. Підприємство реалізує пральні машини в невеликих обсягах. При цьому можливі збитки як результат недостатньо вивченого попиту. 700 тис. грн. з ймовірністю 0,4; 500 тис. грн. з ймовірністю 0,5 і 300 тис. грн. несподіваний дохід з ймовірністю 0,1. Визначте ступінь ризику підприємства за показником сподіваних збитків.

Задача 2. Протягом 50 днів у продавця були такі обсяги реалізації товару: 4 дні - по 120 од.; 10 днів - по 200; 18 днів - по 300; 9 днів - по 250; 6 днів - по 180; 3 дні - по 100. Продавець закупував товар по 30 гривень за одиницю а продав за 40. Якщо товар не був проданий то він псується і продавець несе збитки. Визначте оптимальну кількість партії товару, яку необхідно закупувати продавцю в даних умовах попиту за критерієм Байєса.

Чорноморський національний університет імені Петра Могили

Рівень вищої освіти: другий (магістерський)

Галузь знань 07 «Управління та адміністрування»

Спеціальність 076 «Підприємництво, торгівля і біржова діяльність»_ Семестр ІХ

Навчальна дисципліна Д2,3,4 Управління ризиками підприємства

ЕКЗАМЕНАЦІЙНИЙ БІЛЕТ №0

1. Ризики підприємства – сутність і природа. (13 балів).
2. Основні принципи управління ризиками підприємства. (13 балів).
3. Задача (14 балів).

Магазин “Молоко” продає в роздріб молочні продукти. Директор магазину повинен визначити, скільки бідонів сметани необхідно закупити і виробника для торгівлі протягом тижня. Ймовірність того, що попит на сметану протягом тижня буде 7, 8, 9 або 10 бідонів, дорівнюють відповідно 0,2; 0,2; 0,5; 0,1. Купівля одного бідона сметани обходиться магазину в 700 грн., а продається він за 1100 грн. Якщо сметана не продається протягом тижня, то вона псується, і магазин несе збитки. Скільки бідонів сметани необхідно придбати для продажу щоб забезпечити максимальний сподіваний прибуток?

Затверджено на засіданні
кафедри економіки підприємства

Протокол № _____ від „_____” _____ 20____ року

Завідувач кафедри економіки
підприємства

Екзаменатор

_____ (підпис)

_____ (підпис)

Кузьменко О.Б.

Кузьменко О.Б.

Проведення підсумкового контролю знань. Результатом вивчення дисципліни виступає екзамен. Умовою допуску до підсумкового контролю знань є позитивні оцінки з поточного контролю знань. Контроль знань студентів здійснюється за 100-бальною шкалою. Максимальну кількість балів, яку може отримати студент протягом семестру становить 60 балів. На екзамені максимальна кількість балів - 40 балів.

Екзаменаційний білет складається з двох теоретичних питань та задачі, за правильну відповідь на перше та друге питання студент отримує по 13 балів, а за розв’язану задачу 14 балів.

6. Методи навчання

Пояснювально-ілюстративний метод: застосовується при викладанні лекцій. Студенти сприймають і осмислюють факти, оцінки, висновки.

Частково-пошуковий (евристичний) метод: застосовується при відповіді на тести, питання, розв’язуванні задач, виконанні аналітичної роботи. Студенти осмислюють умови тесту, задачі, аналітичної роботи, актуалізують отримані раніше знання та навички, самостійно вирішують, аналізують, порівнюють, роблять висновки, узагальнюють, перевіряють результати роботи.

7. Критерії оцінювання та засоби діагностики результатів навчання

Денна форма

№	Вид діяльності (завдання)	Максимальна кількість балів
1	Тести (15×16)	15
2	Опитування (18×16)	18
3	Розв’язування задач (17×16)	17
4	Аналітична робота (1×106)	10
5	Екзамен (1×406)	40

Всього	100
---------------	------------

Критерії оцінки знань студентів.

Тести: правильна буква відповіді на один тест – 1 бал, неправильна – 0 балів.

Опитування: правильна відповідь в повному обсязі на поставлене питання – 1 бал, інші варіанти – 0 балів.

Розв'язування задач: правильно розв'язана одна задача, оформлена в зошиті, з ходом рішення і у встановлений термін – 1 бал; задача не розв'язана вірно – 0 балів.

Аналітична робота: виконана у встановлений термін, згідно всіх вимог і без зауважень – 10 балів; виконана з незначним порушенням терміну, має зауваження по оформленню, списку літератури або суто арифметичні помилки у розрахунках – 5 балів; виконана зі значним порушенням терміну, має суттєві зауваження в теоретичній, аналітичній або рекомендаційній частинах – 3 бали; не виконана робота – 0 балів

Заочна форма

№	Вид діяльності (завдання)	Максимальна кількість балів
1	Тести (20×1б)	20
2	Опитування (4×1б)	4
3	Розв'язування задач (3×2б)	6
4	Контрольна робота (1×30б)	30
5	Екзамен (1×40б)	40
	Всього	100

Критерії оцінки знань студентів.

Тести: правильна буква відповіді на один тест – 1 бал, неправильна – 0 балів.

Опитування: правильна відповідь в повному обсязі на поставлене питання – 1 бал, інші варіанти – 0 балів.

Розв'язування задач: правильно розв'язана одна задача, оформлена в зошиті, з ходом рішення і у встановлений термін – 2 бали; задача розв'язана з суто арифметичними помилками, які не вплинули на хід рішення та незначним перевищенням терміну – 1 бал; інші варіанти – 0 балів.

Контрольна робота: виконана у встановлений термін, згідно всіх вимог і без зауважень – 30 балів; виконана з незначним порушенням терміну, має зауваження по оформленню, списку літератури або суто арифметичні помилки у розрахунках – 20 балів; виконана зі значним порушенням терміну, має суттєві зауваження в теоретичній, аналітичній або рекомендаційній частинах – 10 балів; не виконана робота – 0 балів

Матеріально-технічне забезпечення дисципліни

Проекційне мультимедійне обладнання (проектор, екран, ноутбук/комп'ютер);

Доступ до мережі Internet, точка доступу Wi-Fi;

OS: Windows, Android, iOS;

Browsers: Chrome / Opera / Mozilla Firefox / MS Edge;
 Програмне забезпечення: Word, Excel, PowerPoint; Skype, Zoom, Google Meet;
 Система електронного навчання Moodle 3.9

8. Рекомендовані джерела інформації

8.1. Основні:

1. Економічний ризик: методи оцінки та управління [Текст] : 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.
2. Посохов І.М. Управління ризиками у підприємстві: навчальний посібник \ І. М. Посохов. – Харків : НТУ «ХП», 2015. – 220 с.

8.2. Додаткові:

3. Вітлінський В.В., Верченко П.І. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком.- Навч. посібник / В.В. Вітлінськи, П.І. Верченко. – Київ: КНЕУ, 2000р. – 292с.
4. Донець Л.І. Економічні ризики та методи їх вимірювання: Навчальний посібник / Л.І. Донець . — К.: Центр навчальної літератури, 2006. — 312 с.
5. Кузьменко О.Б. Управління ризиком: Збірник завдань для виконання контрольної роботи студентами заочної форми навчання спеціальності 6.050104 «Фінанси» / О.Б. Кузьменко – Миколаїв: Вид-во МДГУ ім. Петра Могили, 2008. – Вип.94. – 44 с.
6. Кучеренко В.Р. Економічний ризик та методи його вимірювання: Навчальний посібник / В.Р. Кучеренко, В.А. Карпов, А.В. Карпов. – Одеса, 2011. – 199с.
7. Ліщинський О.Л. Економічний ризик та методи його вимірювання: Навч. посібник для вузів / О.Л. Ліщинський: Київ. ЦНЛ. – 2005 р.
8. Матвійчук А.В. Аналіз і управління економічним ризиком: Навч. посібник для вузів / А.В. Матвійчук. Київ.: ЦНЛ – 2005 р.
9. Машина М.І. Економічний ризик та методи його вимірювання: навч. посібник / М.І. Машина.– Київ: Центр навчальної літератури, 2005 .– 188с.
- 10.Офіційний веб-портал Верховної ради України. Режим доступу: <https://rada.gov.ua/news/zak>