

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
Львівський національний університет ветеринарної медицини
та біотехнологій імені С.З. Гжицького

Факультет економіки та менеджменту
Кафедра інформаційних технологій у менеджменті

ЗАТВЕРДЖУЮ

Декан факультету

Гримак О.Я.

(прізвище та ініціали, підпис)

“ 26 ” 08 2021 року

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

КК 8 РИЗИК У МЕНЕДЖМЕНТІ

(код і назва навчальної дисципліни)

рівень вищої освіти	Перший (бакалаврський) (назва освітнього рівня)
галузь знань	07 «Управління та адміністрування» (назва галузі знань)
спеціальність	073 «Менеджмент» (назва спеціальності)
освітня програма	«Менеджмент» (назва)
вид дисципліни	За вибором (обов'язкова / за вибором)

Львів – 2021 р.

Робоча програма з навчальної дисципліни «Ризик у менеджменті» для студентів першого (бакалаврського) освітнього рівня спеціальності 073 «Менеджмент» за освітньою програмою «Менеджмент»

Укладачі:

к.ф.-м.н., доцент.
(посада, науковий ступінь та вчене звання)

Єлейко О.І.
(ініціали та прізвище)

Робоча програма розглянута та схвалена на засіданні кафедри інформаційних технологій у менеджменті

(назва кафедри)
протокол № 1 від «25» 08 2021 року

завідувач кафедри ІТМ
(назва кафедри)



Степанюк О.І.
(прізвище та ініціали)

Погоджено навчально-методичною комісією

спеціальності менеджмент
(назва спеціальності)

протокол № 1 від «25» серпня 2021 р.

Голова НМКС М.В. Вовк
(підпис, прізвище та ініціали)

Вовк М.В.

Схвалено рішенням навчально-методичної

ради факультету економіки та менеджменту
(назва факультету)

протокол № 1 від «26» 08 2021 р.

Голова НМРФ С.І. Поперечний
(підпис, прізвище та ініціали)

Поперечний С.І.

Ухвалено вченою радою факультету

протокол № 1 від «26» серпня 2021 р.

1. ОПИС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Найменування показників	Всього годин	
	Денна форма навчання	Заочна форма навчання
Кількість кредитів/годин	3/90	3/90
Усього годин аудиторної роботи	44	10
в т.ч.:		
• лекційні заняття, год.	12	4
• практичні заняття, год.	32	6
• лабораторні заняття, год		
семінарські заняття, год		
Усього годин самостійної роботи	46	80
Форма контролю	залік	залік

Примітка.

Частка аудиторного навчального часу студента у відсотковому вимірі:

для денної форми навчання – 45:55%

для заочної форми навчання – 15:85%

2. ПРЕДМЕТ, МЕТА ТА ЗАВДАННЯ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

2.1. Предмет, мета вивчення навчальної дисципліни

Предметом вивчення дисципліни «Ризик у менеджменті» є дослідження економічної системи, ефективність і умови функціонування якої наперед точно не відомі, подолання невизначеності та конфліктності в ситуації неминучого вибору.

Основною метою викладення є озброїти майбутніх фахівців з економіки, бізнесу та менеджменту систематизованими знаннями щодо аналізу, моделювання та управління ризиком у менеджменті.

2.2.Завдання навчальної дисципліни

Завдання дисципліни – надання студентам знань з основних розділів ризик у менеджменті та вироблення практичних навичок їх застосувань у майбутній професійній діяльності.

2.3.Програмні результати навчання

У результаті вивчення дисципліни студент повинен

знати:

- основні поняття теорії ризику;
- основні класифікації економічних ризиків;

- основні методи управління економічним ризиком;

вміти:

- здійснювати якісний і кількісний аналіз ризику;
- ідентифікувати ризик;
- проводити відповідні обчислення, використовуючи сучасні ЕОМ та відповідні програмно-методичні комплекси;
- оцінювати міру ризику за певними адекватними цілям і системі прийнятих гіпотез кількісними показниками;
- контролювати, моделювати й враховувати ризик, управляти ним, застосовуючи відповідні методи економічної ризикології.

3. СТРУКТУРА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

3.1. Розподіл навчальних занять за розділами дисципліни

Назви тем	Кількість годин											
	денна форма						Заочна форма					
	усього	у тому числі					усього	у тому числі				
		л	п	лаб.	інд.	с.р.		л	п	лаб.	інд.	с.р.
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Тема 1 Ризик у менеджменті та основні принципи його аналізу, управління	8	2	2			4	8					8
Тема 2 Система кількісних оцінок економічного ризику	8	2	2			4	13	1	2			10
Тема 3 Ризик та елементи теорії корисності	10	2	4			4	11	1	2			8
Тема 4 Основні засади та способи управління ризиком	10	2	4			4	10					10
Тема 5 Диверсифікація як спосіб зниження ризику	10	2	4			4	9	1				8
Тема 6 Моделювання ризику та концепція теорії гри	10	2	4			4	13	1	2			10
Тема 7 Ризик та системні властивості економічних рішень	12		4			8	8					8
Тема 8 Стратегічний (інвестиційний) менеджмент та ризик	12		4			8	8					8
Тема 9 Запаси та резерви як спосіб зниження ступеня ризику	10		4			6	10					10
Усього годин	90	12	32	0	0	46	90	4	6	0	0	80

3.2. Лекційні заняття

№ п/п	Назва	К-ть год.	
		ДФЗО	ЗФЗО
ТЕМА 1: РИЗИК У МЕНЕДЖМЕНТІ ТА ОСНОВНІ ПРИНЦИПИ ЙОГО АНАЛІЗУ, УПРАВЛІННЯ			
1	Загальні проблеми, основні цілі менеджменту та ризик. Аналіз ризику. Класифікація ризику. Основні підходи до процесу управління ризиком. структура ризику та поведження менеджерів.	2	
ТЕМА 2: СИСТЕМА КІЛЬКІСНИХ ОЦІНОК ЕКОНОМІЧНОГО РИЗИКУ			
2	Загальні підходи щодо кількісної оцінки ризику. Ризик в абсолютному виразі. Допустимий, критичний та катастрофічні ризики. Оцінка ризику ліквідності. Коефіцієнт чутливості β .	2	1
ТЕМА 3: РИЗИК ТА ЕЛЕМЕНТИ ТЕОРІЇ КОРИСНОСТІ			
3	Концепція корисності. Пріоритети та їх числове вираження. Корисність за Нейманом. Сподівана корисність. Детермінований елемент і премія за ризик. Криві схильності-несхильності до ризику.	2	1
ТЕМА 4: ОСНОВНІ ЗАСАДИ ТА СПОСОБИ УПРАВЛІННЯ РИЗИКОМ			
4	Концепція управління ризиком у спектрі економічних проблем. Узагальнена блок-схема процесу управління ризиком. Зовнішні способи зниження ступеня ризику. Внутрішні способи зниження ступеня ризику.	2	
ТЕМА 5: ДИВЕРСИФІКАЦІЯ ЯК СПОСІБ ЗНИЖЕННЯ РИЗИКУ			
5	Сутність диверсифікації. Управління портфелем. Портфель з двох видів економічної діяльності та оптимізація його структури. Класична модель формування портфеля.	2	1
ТЕМА 6. МОДЕЛЮВАННЯ РИЗИКУ ТА КОНЦЕПЦІЯ ТЕОРІЇ ГРИ			
6	Теоретико-ігрова модель. Функція ризику. Критерії прийняття рішень при заданому розподілі ймовірностей.	2	1

	Інформаційні ситуації та критерії прийняття рішень в умовах ризику.		
ТЕМА 7. РИЗИК ТА СИСТЕМНІ ВЛАСТИВОСТІ ЕКОНОМІЧНИХ РІШЕНЬ			
7	Системні властивості рішень. Еластичність рішень. Надійність та ризикованість планів розвитку та функціонування економічних об'єктів. Маневреність рішень.		
ТЕМА 8. СТРАТЕГІЧНИЙ (ІНВЕСТИЦІЙНИЙ) МЕНЕДЖМЕНТ ТА РИЗИК			
8	Загальні засади стратегічного менеджменту з урахуванням ризику. Основні принципи розробки інвестиційної стратегії з урахуванням ризику. Методи оцінки інвестиційних проектів з урахуванням ризику. Ризик щодо прийняття інвестиційних рішень. Вплив інвестиційних проектів на ризик фірми. Принципи формування інвестиційного портфеля з урахуванням ризику.		
ТЕМА 9. ЗАПАСИ ТА РЕЗЕРВИ ЯК СПОСІБ ЗНИЖЕННЯ СТУПЕНЯ РИЗИКУ			
9	Структура та види запасів, резервів на непередбачувані витрати. Спрощені економіко-математичні моделі формування раціональних запасів. Задачі управління виробництвом та резервами.		
	Усього годин	12	4

3.3. Практичні (лабораторні, семінарські) заняття

№ п/п	Назва	К-ть год.	
		ДФЗО	ЗФЗО
ТЕМА 1: РИЗИК У МЕНЕДЖМЕНТІ ТА ОСНОВНІ ПРИНЦИПИ ЙОГО АНАЛІЗУ, УПРАВЛІННЯ			
1	Аналіз ситуацій, обтяжених ризиком	2	
ТЕМА 2: СИСТЕМА КІЛЬКІСНИХ ОЦІНОК ЕКОНОМІЧНОГО РИЗИКУ			
2	Розрахунок основних кількісних показників ризику	2	2
ТЕМА 3: РИЗИК ТА ЕЛЕМЕНТИ ТЕОРІЇ КОРИСНОСТІ			
3	Корисність за Нейманом. Сподівана корисність	4	2
ТЕМА 4: ОСНОВНІ ЗАСАДИ ТА СПОСОБИ УПРАВЛІННЯ РИЗИКОМ			
4	Зовнішні і внутрішні способи зниження ступеня ризику	4	
ТЕМА 5: ДИВЕРСИФІКАЦІЯ ЯК СПОСІБ ЗНИЖЕННЯ РИЗИКУ			
5	Портфель з двох видів економічної діяльності та оптимізація його структури	4	
ТЕМА 6. МОДЕЛЮВАННЯ РИЗИКУ ТА КОНЦЕПЦІЯ ТЕОРІЇ ГРИ			
6	Тема: «Інформаційні ситуації та критерії прийняття рішень в умовах ризику»	4	2
ТЕМА 7. РИЗИК ТА СИСТЕМНІ ВЛАСТИВОСТІ ЕКОНОМІЧНИХ РІШЕНЬ			
7	Системні властивості рішень	4	
ТЕМА 8. СТРАТЕГІЧНИЙ (ІНВЕСТИЦІЙНИЙ) МЕНЕДЖМЕНТ ТА РИЗИК			
8	Основні принципи розробки інвестиційної стратегії з урахуванням ризику. Принципи формування інвестиційного портфеля з урахуванням ризику.	4	
ТЕМА 9. ЗАПАСИ ТА РЕЗЕРВИ ЯК СПОСІБ ЗНИЖЕННЯ СТУПЕНЯ РИЗИКУ			

9	Тема: «Розрахунок обсягів запасів і резервів для зниження ступеня ризику.»	4	1
	Усього годин	32	12

3.4. Самостійна робота

№ п/п	Назва	К-ть год.	
		ДФЗО	ЗФЗО
ТЕМА 1: РИЗИК У МЕНЕДЖМЕНТІ ТА ОСНОВНІ ПРИНЦИПИ ЙОГО АНАЛІЗУ, УПРАВЛІННЯ			
1	Загальні проблеми, основні цілі менеджменту та ризик. Аналіз ризику. Класифікація ризику. Основні підходи до процесу управління ризиком. структура ризику та поведження менеджерів.	4	8
ТЕМА 2: СИСТЕМА КІЛЬКІСНИХ ОЦІНОК ЕКОНОМІЧНОГО РИЗИКУ			
2	Загальні підходи щодо кількісної оцінки ризику. Ризик в абсолютному виразі. Допустимий, критичний та катастрофічні ризики. Оцінка ризику ліквідності. Коефіцієнт чутливості β .	4	10
ТЕМА 3: РИЗИК ТА ЕЛЕМЕНТИ ТЕОРІЇ КОРИСНОСТІ			
3	Концепція корисності. Пріоритети та їх числове вираження. Корисність за Нейманом. Сподівана корисність. Детермінований елемент і премія за ризик. Криві схильності-несхильності до ризику.	4	8
ТЕМА 4: ОСНОВНІ ЗАСАДИ ТА СПОСОБИ УПРАВЛІННЯ РИЗИКОМ			
4	Концепція управління ризиком у спектрі економічних проблем. Узагальнена блок-схема процесу управління ризиком. Зовнішні способи зниження ступеня ризику. Внутрішні способи зниження ступеня ризику.	4	10
ТЕМА 5: ДИВЕРСИФІКАЦІЯ ЯК СПОСІБ ЗНИЖЕННЯ РИЗИКУ			
5	Сутність диверсифікації. Управління портфелем. Портфель з двох видів економічної діяльності та оптимізація його структури. Класична модель формування портфеля.	4	8
ТЕМА 6. МОДЕЛЮВАННЯ РИЗИКУ ТА КОНЦЕПЦІЯ ТЕОРІЇ ГРИ			
6	Теоретико-ігрова модель. Функція ризику. Критерії прийняття рішень при заданому розподілі ймовірностей.	4	10

	Інформаційні ситуації та критерії прийняття рішень в умовах ризику.		
ТЕМА 7. РИЗИК ТА СИСТЕМНІ ВЛАСТИВОСТІ ЕКОНОМІЧНИХ РІШЕНЬ			
7	Системні властивості рішень. Еластичність рішень. Надійність та ризикованість планів розвитку та функціонування економічних об'єктів. Маневреність рішень.	8	8
ТЕМА 8. СТРАТЕГІЧНИЙ (ІНВЕСТИЦІЙНИЙ) МЕНЕДЖМЕНТ ТА РИЗИК			
8	Загальні засади стратегічного менеджменту з урахуванням ризику. Основні принципи розробки інвестиційної стратегії з урахуванням ризику. Методи оцінки інвестиційних проектів з урахуванням ризику. Ризик щодо прийняття інвестиційних рішень. Вплив інвестиційних проектів на ризик фірми. Принципи формування інвестиційного портфеля з урахуванням ризику.	8	8
ТЕМА 9. ЗАПАСИ ТА РЕЗЕРВИ ЯК СПОСІБ ЗНИЖЕННЯ СТУПЕНЯ РИЗИКУ			
9	Структура та види запасів, резервів на непередбачувані витрати. Спрощені економіко-математичні моделі формування раціональних запасів. Задачі управління виробництвом та резервами.	6	10
	Підготовка до навчальних занять та контрольних заходів		
	Усього годин	66	80

4. Індивідуальні завдання

Протягом семестру студент для покращення поточного контролю може виконати індивідуальне завдання, яке оцінюється відповідною кількістю балів (максимум 5 балів).

5. Методи навчання

Вивчення дисципліни проводиться за допомогою наступних методів:

- викладання лекційного матеріалу;
- використання комп'ютерних тестів і програм
- проведення лабораторних досліджень, аналіз і оцінка їх результатів;
- науково-дослідна робота;
- самостійна робота студентів.

Основними видами занять згідно з навчальним планом є:

- лекції;
- лабораторні заняття;
- самостійна робота студентів.

6. Методи контролю

Система оцінювання здійснюється відповідно до вимог програми дисципліни.

Форми проведення поточного контролю рівня знань студентів впродовж семестру:

- усна співбесіда;
- експрес-контроль (тестовий);
- дискусія при захисті звіту;
- консультація з метою контролю.

Поточний контроль здійснюється на кожному лабораторному занятті відповідно до конкретних цілей теми. За поточну навчальну роботу студенту виставляється оцінка за 5-ти бальною шкалою. Оцінювання самостійної роботи студентів проводиться під час поточного контролю теми на відповідному аудиторному занятті.

Підсумковий контроль проводиться за 100-бальною шкалою, з якою є узгодженими національна шкала і шкала ECTS.

7. Критерії оцінювання результатів навчання студентів

Система оцінювання здійснюється відповідно до вимог програми дисципліни та «Тимчасового положення про організацію освітніх послуг у ЛНУВМ БТ імені С. З. Гжицького - 2015» від 30.06.2015 р.

Поточний контроль проводиться викладачем під час аудиторних занять. Основне завдання поточного контролю – перевірка рівня підготовки студентів до виконання конкретної навчальної роботи, діагностика рівня сформованості компетенції з метою його підвищення.

Основна мета поточного контролю – забезпечення зворотного зв'язку між викладачем та студентами у процесі навчання, управління освітнім процесом.

Інформація, отримана в процесі поточного контролю, використовується як викладачем (для коригування методів і засобів навчання), так і студентами (для самоаналізу та самооцінки своєї освітньої діяльності).

Поточний контроль може проводитись у формі усного опитування, письмового експрес-контролю, контрольних робіт, комп'ютерного тестування, виступів студентів при обговоренні питань на практичних (семінарських) заняттях тощо.

Всі види поточних контрольних заходів оцінюються за національною шкалою, входять в обчислення середнього арифметичного значення (САЗ).

7.1. Денна форма

Критерії оцінювання студентів денної форми здобуття освіти

При визначенні рівня успішності студентів використовують систему оцінки знань, яка зорієнтована на стимулювання систематичної аудиторної та самостійної роботи студентів. Оцінювання результатів навчання студентів здійснюється шляхом проведення поточного та підсумкового контролю (екзаменаційного, залікового та підсумкової атестації). Оцінювання результатів навчання проводиться в балах, максимальна кількість яких за кожний підсумковий контроль становить 100. Кожній сумі балів відповідає оцінка за національною шкалою та шкалою ЄКТС (табл. 1).

Розподіл балів для дисциплін, які завершуються заліком, є таким:

$$100 \text{ (ПК)} = 100;$$

де: 100 (ПК) - 100 максимальна кількість балів з поточного контролю, яку може набрати здобувач вищої освіти за семестр.

Результати поточного контролю оцінюються за чотирибальною («2», «3», «4», «5») шкалою:

«5» – студент активно працює на практичному занятті, дає повні правильні відповіді на запитання, приймає участь у дискусії, вирішує завдання;

«4» – студент повністю виконує завдання, демонструє знання теоретичних питань, але допускає неточності;

«3» – студент частково виконує завдання, наводить правильні формули, шляхи вирішення проблеми, але допускає помилки, частково відвідає на теоретичні запитання;

«2» – студент не виконує завдання, не відвідає на теоретичні запитання.

Таблиця 1

Шкала оцінювання: національна та ECTS

Сума балів за всі види навчальної діяльності	Оцінка ECTS	Оцінка за національною шкалою	
		іспит	залік
90 – 100	A	відмінно	зараховано
82-89	B	добре	
74-81	C		
64-73	D	задовільно	
60-63	E		
35-59	FX	незадовільно з можливістю повторного складання	не зараховано з можливістю повторного складання
0-34	F	незадовільно з обов'язковим повторним вивченням дисципліни	не зараховано з обов'язковим повторним вивченням дисципліни

Результати поточного контролю оцінюються за чотирибальною («2», «3», «4», «5») шкалою:

«5» – студент активно працює на практичному занятті, дає повні правильні відповіді на запитання, приймає участь у дискусії, вирішує завдання;

«4» – студент повністю виконує завдання, демонструє знання теоретичних питань, але допускає неточності;

«3» – студент частково виконує завдання, наводить правильні формули, шляхи вирішення проблеми, але допускає помилки, частково відвідає на теоретичні запитання;

«2» – студент не виконує завдання, не відвідає на теоретичні запитання.

В кінці семестру обчислюється середнє арифметичне значення (САЗ) усіх отриманих студентом оцінок з наступним переведенням його у бали за формулою:

$$ПК = (100 \cdot САЗ) / 5 = 20 \cdot САЗ$$

Бал з поточного контролю може бути змінений за рахунок заохочувальних балів:

- студентам, які не мають пропусків занять протягом семестру (додається 2 бали);

- за участь в університетських студентських олімпіадах, наукових конференціях (додається 2 бали), на міжвузівському рівні (додається 5 балів);

- за інші види навчально-дослідної роботи бали додаються за рішенням кафедри.

7.2. Заочна форма

Критерії оцінювання студентів заочної форми здобуття освіти

Успішність здобувача вищої освіти оцінюється шляхом проведення поточного та підсумкового контролю. Максимальна кількість балів за кожний заліковий кредит з навчальної дисципліни, яку може отримати студент протягом семестру, становить 100. Дані про успішність студента заносяться викладачами у «Журнал обліку відвідування занять та контролю успішності студентів», «Залікову відомість», «Екзаменаційну відомість». У зв'язку з тим, що для здобувачів вищої освіти заочної форми навчання співвідношення обсягу годин, відведених на аудиторні заняття та самостійну роботу, має значні відмінності від денної форми (для кожної дисципліни визначається навчальною та робочою програмами), відповідно є відмінності у розподілі балів для дисциплін та критеріїв оцінювання. Розподіл балів для здобувачів вищої освіти заочної форми навчання є таким:

$$30 (\text{ПК}) + 70 (\text{ТСР}) = 100$$

30 (ПК) - 30 максимальних балів з поточного контролю (ПК), які може набрати здобувач вищої освіти під час заліково-екзаменаційної сесії.

70 (ТСР) - бали за виконання тематичної самостійної роботи у міжсесійний період за програмою курсу

8. Навчально-методичне забезпечення

1. Єлейко О.І., Диндин М.Л., Рамський І.О. Ризик у менеджменті. Програма, методичні поради і завдання для контрольної роботи студентам економічних спеціальностей. Львів, 2020. 16 с.
2. Єлейко О.І., Диндин М.Л., Рамський І.О. Ризик у менеджменті. Методичні поради студентам економічних спеціальностей для самостійного вивчення теми «Управління ризиком». Львів, 2020. 20 с.
3. Єлейко О.І., Рамський І.О. Ризик у менеджменті. Завдання для контрольних робіт. Львів, 2020. 22 с.

9. Рекомендована література

Базова

1. Вітлінський В.В., Наконечний С.І. Ризик у менеджменті. К. : ТЗОВ «Борисфен-М», 1996. 336с.

2. Вітлінський В.В., Верченко П.І. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком : Навч.-метод. посібник для самостійного вивчення дисципліни К. : КНЕУ, 2000. 292с.
3. Єлейко Я.І., Єлейко О.І., Раєвський К.Є. Інвестиції, ризик, прогноз: Навч. посібник - Львів: Львівський банківський інститут НБУ, 2000. 176с.
4. Ястремський О.І. Основи економічного ризику : Навч. посібник. К. : “АртЕк”, 1997. 248с.
5. Верченко П.І. Багатокритеріальність і динаміка економічного ризику (моделі та методи): [монографія] / П.І. Верченко. К. : КНЕУ, 2006. 272 с.

Допоміжна

1. Бочарников В.П., Релецкий С.М. и др. Риски во внешнеэкономической деятельности предприятий. К. : ИНЭКС, 1997. 170с.
2. Грабовый П.Г., Петрова С.Н. и др. Риски в современном бизнесе. М.: Аланс, 1994. 200с.
3. Машина Н.І. Економічний ризик та методи його вимірювання / Машина Н.І. Київ : Центр навчальної літератури, 2003. 188 с.

10. Інформаційні ресурси

1. Національна бібліотека України імені В.І.Вернадського : веб-сайт. URL: <http://www.nbu.gov.ua/>
2. Львівська національна наукова бібліотека України імені В. Стефаника : веб-сайт. URL: <http://www.lsl.lviv.ua/index.php/ulc/golovna2/>