

**НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ ВОДНОГО ГОСПОДАРСТВА ТА
ПРИРОДОКОРИСТУВАННЯ**

Навчально-науковий інститут економіки та менеджменту

06-01-166S

СИЛАБУС

навчальної дисципліни

SYLABUS

Ризик-менеджмент у міжнародному бізнесі		Risk-management in international business
Шифр за ОП	ОК-38	Code in Degree Programme
Освітній рівень: бакалаврський (перший)		Level of Education: bachelor's (first)
Галузь знань: Міжнародні відносини	29	Fields of knowledge: International relations
Спеціальність Міжнародні економічні відносини	292	Field of Study International Economic Relations
Освітня програма: Міжнародний бізнес		Degree Programme: International Business

РІВНЕ -2024

Силабус навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент у міжнародному бізнесі» для здобувачів вищої освіти ступеня «бакалавр», які навчаються за освітньо-професійною програмою «Міжнародний бізнес» спеціальності 292 «Міжнародні економічні відносини». Рівне. НУВГП. 2024. 11 стор.

ОП на сайті університету:

<https://nuwm.edu.ua/nni-em/osvitni-prohramy/item/mizhnarodnyi-biznes-2021-spetsialnist-292-mizhnarodni-ekonomichni-vidnosyny>

Розробник силабусу:

Красовська Юліана Вікторівна , к.е.н., доцент кафедри економіки підприємства і міжнародного бізнесу, доцент

Силабус схвалений на засіданні кафедри економіки підприємства і міжнародного бізнесу

Протокол № 8 від “26” грудня 2023 року

Завідувачка кафедри економіки підприємства і міжнародного бізнесу:

Кушнір Ніна Борисівна, к.е.н., професор

Керівник освітньої програми «Міжнародний бізнес»:

Красовська Юліана Вікторівна , к.е.н., доцент

Схвалено науково-методичною радою з якості ННІЕМ

Протокол № 8 від “29” січня 2024 року

Голова науково-методичної ради з якості ННІЕМ:

Ковшун Наталія Едуардівна, д.е.н., професор

© Красовська Ю.В., 2024

© НУВГП, 2024

ЗАГАЛЬНА ІНФОРМАЦІЯ

Ступінь вищої освіти	бакалавр
Освітня програма	Міжнародний бізнес
Спеціальність	292 Міжнародні економічні відносин
Рік навчання, семестр	3-й рік 6-й семестр
Кількість кредитів	3
Лекції:	16 годин (заочна 4 години)
Практичні заняття:	14 годин (заочна 6 годин)
Самостійна робота:	60 годин (заочна 80 годин)
Курсова робота:	ні
Форма навчання	Денна, заочна
Форма підсумкового контролю	екзамен
Мова викладання	українська

ІНФОРМАЦІЯ ПРО ВИКЛАДАЧА

ПРОФАЙЛ ЛЕКТОРА

Красовська Юліана Вікторівна, к.е.н., доцент, доцент кафедри економіки підприємства і міжнародного бізнесу



Вікіситет

URL: <http://wiki.nuwm.edu.ua/index.php>

ORCID

URL: <https://orcid.org/0000-0002-5786-3267>

Як комунікувати

URL: [https://](https://y.v.krasovska@nuwm.edu.ua)

y.v.krasovska@nuwm.edu.ua

Тел. 0688279424

Актуальні оголошення на сторінці
дисципліни в системі MOODLE

ІНФОРМАЦІЯ ПРО НАВЧАЛЬНУ ДИСЦИПЛІНУ

Мета та завдання

Даний курс орієнтований на набуття студентами комплексних теоретичних знань та практичних навичок якісного управління ризиками в сфері міжнародного бізнесу і тим самим підвищувати безпеку функціонування підприємств на міжнародних ринках.

Метою вивчення дисципліни є сприяння формуванню у здобувачів вищої освіти професійних компетентностей у виявленні, оцінюванні та комплексному управлінні ризиками з урахуванням факторів впливу міжнародного бізнес - середовища.

Цілі вивчення дисципліни: оволодіння прийомами і методами ідентифікації ризику в міжнародному бізнесі, навичками кількісної, якісної та інтегральної оцінки ризиків, методами гнучкого та оперативного реагування на зміну зовнішніх та внутрішніх факторів середовища процесі ведення міжнародної економічної діяльності.

Використовуються такі методи викладання та технології: презентації, обговорення, міні- лекції, ситуаційні дослідження та інші.

Мета та завдання

URL: <https://exam.nuwm.edu.ua/course/view.php?id=4757>

Передумови вивчення

Дисципліна «Ризик-менеджмент у міжнародному бізнесі» є складовою частиною обов'язкових освітніх компонентів циклу фахової підготовки студентів спеціальності «Міжнародні економічні відносини» за освітньою програмою «Міжнародний бізнес».

Для вивчення даного курсу студентам необхідні знання з таких дисциплін, як: «Статистика», «Вища математика», «Макроекономіка», «Мікроекономіка», «Міжнародні економічні відносини».

Компетентності

ФК 3. Здатність виявляти особливості функціонування середовища міжнародних економічних відносин та моделей економічного розвитку.

ФК 5. Здатність здійснювати комплексний аналіз та моніторинг кон'юнктури світових ринків, оцінювати зміни міжнародного середовища

та вміти адаптуватися до них.

ФК 13. Здатність проводити оцінку та аналіз безпекової компоненти у міжнародних економічних відносинах.

ФК 15. Здатність застосувати методи, правила і принципи функціонування міжнародних економічних відносин для розвитку зовнішньоекономічної діяльності України.

Програмні результати навчання

ПРН17. Визначати причини, типи та характер міжнародних конфліктів і суперечок, обґрунтовувати і застосовувати економічні, юридичні та дипломатичні методи і засоби їх вирішення на міжнародному рівні, відстоюючи національні інтереси України.

ПРН20. Відстоювати національні інтереси України з урахуванням безпекової компоненти міжнародних економічних відносин.

ПРН22. Застосовувати відповідні методи, правила і принципи функціонування міжнародних економічних відносин для розвитку зовнішньоекономічної діяльності України.

Структура та зміст освітнього компонента

Лекції 16 (4) год Практичні заняття 14 (4) год Самостійна робота 60 (82) год

Лекції та практичні заняття

Тема 1. Сутність ризику як економічної категорії

Результати навчання ПР17	Кількість годин: лекції – 2/1 практичні – 0/0	Література: 1,2,3,6,7,9,10,13
Опис теми	Поняття ризику. Економічний ризик. Еволюція поглядів на феномен ризику. Основні елементи ризику: об'єкти, суб'єкти та джерело ризику. Основні причини виникнення ризику. Внутрішні та зовнішні умови, що зумовлюють ризик. Види втрат у підприємницькій діяльності: матеріальні, трудові, фінансові, втрати часу, спеціальні види втрат. Класифікація ризику. Динамічний і статичний ризик. Чисті і спекулятивні ризики. Ризик цінних паперів. Ризик у фінансовому менеджменті. Банківський ризик. Валютний ризик. Інвестиційний ризик. Поводження суб'єктів ризику. Схильність до ризику. Плата за ризик. Пристосування до ризику: зовнішнє (екстравертність) та внутрішнє (інтравертність).	

Тема 2. Система кількісних та якісних оцінок ризику

Результати навчання ПР22	Кількість годин: лекції – 2/1 практичні – 2/1	Література: 1,2,3,6,7,9,10,13
Опис теми	Ризик в абсолютному виразі: сподівана величина втрат і середньоквадратичне відхилення випадкової величини. Нормальний розподіл значень величин ймовірностей. Ризик у відносному виразі: коефіцієнт ризику і коефіцієнт варіації. Ризик та нерівність Чебишева. Допустимий, критичний та катастрофічний ризики. Крива щільності розподілу ймовірностей випадкових збитків (ризиків). Оцінка ризику ліквідності. Час трансформації інвестицій в грошові кошти та обсяг фінансових втрат інвестора, що пов'язані з цією трансформацією. Коефіцієнти чутливості бета. Систематичний ризик. Методи оцінки економічного ризику: статистичний, аналіз доцільності затрат, метод експертних оцінок, аналітичний, використання аналогів.	

Тема 3. Характеристика ризиків в міжнародному бізнесі

Результати навчання ПР17	Кількість годин: лекції – 2/0 практичні – 2/1	Література: 4,8,11,12,14
Опис теми	Глобальні загрози міжнародному бізнесу. Ризики у міжнародному бізнесі. Світові карти ризиків. Політичні ризики. Ризики, пов'язані з процесом митного оформлення. Транспортні ризики. Ризики, пов'язані з основними положеннями зовнішньоекономічного контракту. Ризик вибору і оцінки надійності партнера. Ризики реалізації.	
Тема 4. Основні засади ризик менеджменту		
Результати Навчання ПР20, ПР22	Кількість годин: лекції – 2/1 практичні – 2/1	Література: 1,2,3,6,7,9,10,13
Опис теми	Основні засади ризик менеджменту. Поняття ризик-менеджменту (PM). Основні правила ризик-менеджменту. Менеджер із ризику та його функції. Сучасні підходи в ризик-менеджменті. Етапи інтегрованого ризик-менеджменту. Розроблення програми управління ризиками (ПУР) на підприємстві. Міжнародні стандарти ризик-менеджменту. Основні способи зниження ступеня ризику. Диверсифікація, як спосіб зниження ризику. Теорія портфеля. Структура портфеля цінних паперів. Ризик портфеля. Диверсифікований і недиверсифікований ризик. Модель ув'язки систематичного ризику і доходності цінних паперів (CAPM). Запаси і резерви як способи зниження ризику. Основні види матеріальних запасів. Види резервів, які можуть бути використані для зниження ступеня ризику в менеджменті. Страхування ризику. Суть основних видів страхування.	
Тема 5. Особливості управління ризиками в міжнародному бізнесі		
Результати Навчання ПР20, ПР22	Кількість годин: лекції – 2/1 практичні – 2/1	Література: 2,5,6,8,12,14,15,16
Опис теми	Хеджування за допомогою форвардних і ф'ючерсних контрактів. Хеджування за допомогою своп угод. Опціон як інструмент хеджування. Страхування ризиків у міжнародному бізнесі. Порівняльна характеристика методів страхування та хеджування ризиків.	
Тема 6. Ризик менеджмент міжнародної інвестиційної діяльності		
Результати Навчання ПР17, ПР20	Кількість годин: лекції – 2/0 практичні – 2/1	Література: 6, 8, 14, 15, 16
Опис теми	Особливості міжнародних інвестиційних проектів. Характеристика інвестиційних ризиків. Методи оцінки інвестиційних проектів з урахуванням ризику. Показники ефективності міжнародних інвестицій з урахуванням ризику. Чистий (нетто) потік грошових коштів. Період окупності інвестицій. Чиста (нетто) теперішня вартість. Внутрішня ставка (норма) доходу. Індекс прибутковості. Аналіз чутливості (вразливості) інвестиційних проектів. Аналіз та оцінка за допомогою методів імітаційного моделювання (корпоративна імітаційна модель). Вплив міжнародних інвестиційних проектів на загальний ризик підприємства. Алгоритм врахування ризиків при обґрунтуванні інвестицій. Принципи формування інвестиційного портфеля з урахуванням ризику.	
Тема 7. Витрати ризик менеджменту		

Результати Навчання ПР22	Кількість годин: лекції – 2/0 практичні – 2/1	Література: 2,6,7,9,10,13
Опис теми	Структура витрат за різних методів управління ризиками. Джерела фінансування витрат ризик менеджменту.	
Тема 8. Оцінка ефективності методів управління ризиками в міжнародному бізнесі		
Результати Навчання ПР20, ПР22	Кількість годин: лекції – 2/0 практичні – 2/0	Література: 2,6,7,9,10,13
Опис теми	Економічні критерії оцінки ефективності управління ризиком. Аналіз ефективності методів управління ризиками. Метод Хаустона.	

Форми та методи навчання

При вивченні дисципліни використовуються традиційні та інноваційні методи навчання: інформаційні, ілюстративні, дискусійні, проблемних ситуацій та кейсів тощо. Лекції супроводжуються демонстрацією схем, таблиць з мультимедійним супроводом. На практичних заняттях розглядаються та розв'язуються задачі, наближені до реальних ситуацій прийняття рішень в умовах ризику. Навчання супроводжується опрацюванням нормативної, навчальної літератури, а також періодичних видань

Інструменти, обладнання, програмне забезпечення

Технічні засоби навчання: мультимедійне обладнання, ноутбук; доступ до інтернету; програмне забезпечення: MS Windows, система дистанційного навчання Moodle.

Порядок оцінювання програмних результатів навчання/результатів навчання

Для досягнення цілей та завдань курсу студентам потрібно вчасно та якісно виконувати завдання, передбачені планом практичних занять, самостійної роботи, вчасно здати модульні контролі знань.

Оцінювання виконаних завдань студентів проводиться шляхом практичної перевірки, опитування та тестування за темами курсу.

За вчасне та якісне виконання практичних завдань та самостійної (індивідуальної) роботи, опанування курсу студент отримує такі обов'язкові бали:

- 50 балів за роботу на практичних заняттях та тестування за окремими темами курсу;
- 10 балів за виконання завдань для самостійної (індивідуальної) роботи ;
- 20 балів – модуль 1;
- 20 балів – модуль 2.

Усього: 100 балів.

Студенти можуть отримати додаткові бали за: виконання рефератів, розробку презентацій за окремими темами курсу. Додаткові бали студентам також можуть бути зараховані за конкретні пропозиції щодо удосконалення змісту навчальної дисципліни.

Модульний контроль проходить у формі тестування. У тесті 25 запитань різної складності: рівень 1 – 22 запитання по 0,5 бала (11 балів), рівень 2 – 2 запитання по 2 бали (4 бали), рівень 3 – 1 запитання по 5 балів (5 балів). Усього – 20 балів.

Дисципліна закінчується заліком, тому результати складання модульних контролів зараховуються як підсумковий контроль.

Рекомендована література (основна, допоміжна)

Основна

1. Вітлінський В.В., Маханець Л.Л. Ризикологія в зовнішньоекономічній діяльності. Навч. посіб. К.: КНЕУ, 2008р. 432 с.
2. Вітлінський В.В., Верченко П.І. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком : [навч.-метод. посіб.]. К. : КНЕУ, 2010. 292 с..
3. Красовська Ю. В., Красовський В. Р. Економічний ризик і методи його вимірювання: Інтерактивний комплекс навчально-методичного забезпечення. Кредитно-модульна система організації навчального процесу. Для студентів напряму підготовки 0501 "Економіка і підприємництво". Рівне: НУВГП, 2007. 112 с.
4. Підприємництво і зовнішньоекономічна діяльність: можливості і ризику України [монографія]. За ред. М.А.Йохни. Хмельницький : ХНУ 2013. 347 с.
5. Подреза С.М. Механізм управління ризиками на підприємстві – суб'єкті зовнішньоекономічної діяльності / С.М. Подреза [Електронний ресурс]. Режим доступу : http://archive.nbu.gov.ua/ejournals/pspe/-2010_4/ Podreza_410.htm.

Допоміжна

6. Андрійчук В., Бауер Л. Менеджмент. Прийняття рішень і ризик: навч. посіб. Київ, 1998. 314 с.
7. Гуменюк В.Я., Міщук Г.Ю., Олійник О.О. Управління ризиками: Навч. посібник Рівне: НУВГП, 2010. 158 с.
8. Дідківський М. І. Зовнішньоекономічна діяльність підприємства: навч. посіб. К.: Знання, 2006. 462 с.
9. Ілляшенко С.М. Економічний ризик: навчальний посібник. К.: Центр навчальної літератури, 2004. 220с.
10. Лукянова В.В., Головач Т.В. Економічний ризик. К.: Академвидав, 2007. 464 с.
11. Свідерська А. Поняття та класифікація ризиків у зовнішньоекономічній діяльності підприємства. Галицький економічний вісник. 2014. Т. 46. № 3. С. 113–121.
12. Таран І.В. Управління ризиками зовнішньоекономічної діяльності при здійсненні експортних операцій. Актуальні проблеми міжнародних відносин. 2005. № 52. Ч. 2. С. 97–100.
13. Тюленева Ю.В. Інтеграційний підхід визначення ризиків підприємства URL : <http://www.economy.nayka.com.ua/?op=1&z=1716>.
14. Тюріна Н.М. Зовнішньоекономічна діяльність підприємства : [навч. посіб.]. К. : ЦУЛ, 2013. 408 с.
15. Ayse Kucuk Yilmaz, Triant Flouris. Corporate Risk Management for International Business (Accounting, Finance, Sustainability, Governance & Fraud: Theory and Application) 1st ed. 2017 Edition.
16. Clark Ephraim, Marois Bernard. Managing Risk in International Business: Techniques and Applications Hardcover – January 1, 1996

Інформаційні ресурси в Інтернет

1. Кабінет Міністрів України. URL: <http://www.kmu.gov.ua/>
2. Законодавство України. URL: <http://www.rada.kiev.ua/>
3. Державний комітет статистики України. URL: <http://www.ukrstat.gov.ua/>

4. Національна бібліотека ім. В.І. Вернадського. URL: <http://www.nbuv.gov.ua/>
5. Рівненська обласна універсальна наукова бібліотека (м. Рівне, майдан Короленка, 6). URL: <http://www.libr.rv.ua/>
6. Eurostat – OECD Manual on Business Demography Statistics. Theme: Industry, Trade and Services. Collection: Methodologies and Working Papers. URL: http://epp.eurostat.ec.europa.eu/cache/ITY_OFFPUB/KS-RA-07-010/EN/KS-RA-07-010-EN.PDF
7. Structural Business Statistics. Reference Metadata in Euro SDMX Metadata Structure (ESMS). URL: http://epp.eurostat.ec.europa.eu/cache/ITY_SDDS/en/sbs_esms.htm#stat_pres
8. OECD et al. SME Policy Index: Eastern Partner Countries 2020: Assessing the Implementation of the Small Business Act for Europe, SME Policy Index. European Union, Brussels/OECD Publishing, Paris, URL: <https://doi.org/10.1787/8b45614b-en> .

Поєднання навчання та досліджень

Студенти мають можливість додатково отримати бали за виконання індивідуальних завдань дослідницького характеру, а також можуть бути долучені до написання та опублікування наукових статей з тематики курсу.

В освітньому процесі використовуються наукові досягнення викладача курсу, що опубліковані у наукових працях (<http://wiki.nuwm.edu.ua/index.php/>).

ПОЛІТИКИ ВИКЛАДАННЯ ТА НАВЧАННЯ

Перелік соціальних, «м'яких» навичок (soft skills)

Адаптивність та гнучкість у прийнятті рішень, навички нестереотипного мислення, наполегливість, допитливість, ініціативність, відповідальність, креативність, аналітичні навички, формування власної думки, здатність до комплексного вирішення проблеми.

Дедлайни та перекладання

Завдання навчальної дисципліни повинні бути виконані продовж 14 днів від дня проведення лекційного чи практичного заняття.

Ліквідація академічної заборгованості здійснюється згідно «Порядку ліквідації академічних заборгованостей у НУВГП» <http://ep3.nuwm.edu.ua/4273/>. Згідно з цим документом і реалізується право студента на повторне вивчення дисципліни чи повторне навчання на курсі.

Перездача модульних контролів здійснюється згідно <http://nuwm.edu.ua/struktorni-pidrozdili/navch-nauk-tsentr-nezaleznoho-otsiniuvannia-znan/dokumenty>.

Оголошення стосовно дедлайнів задачі та перездачі оприлюднюються на сторінці даної дисципліни на платформі MOODLE за календарем:

Неформальна та інформальна освіта

Студенти мають право на перезарахування результатів навчання набутих у неформальній та інформальній освіті згідно відповідного положення <http://nuwm.edu.ua/sp/neformalna-osvita>.

Також студенти можуть самостійно на платформах Prometheus, Coursera, edEx, edEra, FutureLearn та інших опановувати матеріал для перезарахування результатів навчання. При цьому важливо, щоб знання та навички, що формуються під час проходження певного онлайн-курсу чи його частин, мали зв'язок з очікуваними навчальними результатами даної дисципліни (освітньої програми) та перевірялись в підсумковому оцінюванні.

Правила академічної доброчесності

За списування під час проведення модульного контролю чи підсумкового контролю, студент позбавляється подальшого права здавати матеріал і у нього виникає академічна заборгованість.

За списування під час виконання окремих завдань, студенту знижується оцінка відповідно до ступеня порушення академічної доброчесності.

Документи стосовно академічної доброчесності (про плагіат, порядок здачі курсових робіт, кодекс честі студентів, документи Національного агентства стосовно доброчесності) наведені на сторінці ЯКІСТЬ ОСВІТИ сайту НУВГП - <http://nuwm.edu.ua/sp/akademichna-dobrochesnistj>

Всі студенти, співробітники та викладачі НУВГП мають бути чесними у своїх стосунках, що застосовується і поширюється на поведінку та дії, пов'язані з навчальною роботою. Студенти мають самостійно виконувати та подавати на оцінювання лише результати власних зусиль та оригінальної праці, що регламентовано Кодексом честі студента у НУВГП <https://nuwm.edu.ua/sp/akademichnadobrochesnistj>

Принципи доброчесності у НУВГП та відповідність показникам забезпечення якості вищої освіти регламентовано НАЗЯВО та положеннями відділу якості освіти НУВГП.

Сайт НАЗЯВО: <https://naqa.gov.ua/>

Відділ якості освіти НУВГП: <https://nuwm.edu.ua/struktumi-pidrozdili/vyo/dokumenty>

Вимоги до відвідування

Лекції та практичні заняття будуть відбуватися аудиторно або онлайн за допомогою платформи Google Meet згідно із розкладом занять.

Консультації будуть проводитися аудиторно або онлайн за допомогою платформи Google Meet за кодом у домовлений час зі студентами.

Здобувачі можуть на заняттях використовувати мобільні телефони та ноутбуки, але виключно в навчальних цілях з даної дисципліни.

Студенту не дозволяється пропускати заняття без поважних причин.

За об'єктивних причин пропуску занять студенти можуть самостійно вивчити пропущений матеріал на платформі MOODLE

URL: <https://exam.nuwm.edu.ua/course/view.php?id=4618>

Лектор Красовська Ю.В., к.е.н., доцент

Автор
Доцент кафедри економіки
підприємства і міжнародного бізнесу

Юліана КРАСОВСЬКА

Затверджено

Проректор з науково-педагогічної та
навчальної роботи

Валерій СОРОКА



документ підписаний КЕП
Номер документа СИЛ №299
Підписувач Сорока Валерій Степанович
Підписувач (дані КЕП):
Сертифікат 58E2D9E7F900307B0400000807E2D0054327D00