

Course of study (code) / Назва дисципліни (шифр)	РИЗИКОЛОГІЯ IU0734BRZKL	
Academic year / Навчальний рік - Семестр	2022/2023 – 2семестр	
Course of study / Назва спеціальності	073 Менеджмент	
Educational program / Освітня програма Education - ECTS / Рівень – Кредити Status / Статус Learning language / Мова навчання	«Менеджмент» Перший (бакалаврський) рівень - 5 ECTS Вибіркова Українська	
Author / Укладач	Макаренко Віта Олександрівна, кандидат економічних наук, доцент, Державний університет економіки і технологій, e-mail: makarenko_vo@kneu.dp.ua , http://orcid.org/0000-0002-5424-5084 моб. +38097 481 47 16	
Консультації	вт, 14.00-15.00	

A. OBJECTIVE OF THE SUBJECT / МЕТА ТА ЗАВДАННЯ ДИСЦИПЛІНИ

Метою курсу – є засвоєння знань з теоретико-методологічних аспектів основ ризикології; формування у студентів компетентності щодо технології ідентифікації та оцінювання ризиків, що є підґрунтям забезпечення функціонування організації в динамічному ринковому середовищі; техніки підтримки прийняття управлінських рішень на основі ефективного використання відповідних економіко-математичних моделей і методів в умовах ризику та невизначеності.

B. SUBJECT PROGRAM / ПРОГРАМА ДИСЦИПЛІНИ

Тема 1. Поняття ризику та класифікація ризиків.

Невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності та характеристики невизначеності: недостовірність, неоднозначність, невідомість. Типи та розмір невизначеності. Математична, статистична, експертна вірогідність. Причини невизначеності. Поняття ризику та його характеристики. Підприємницький ризик та його формалізація. Класифікація ризиків та характеристика їх основних видів.

Тема 2. Методи оцінювання і моделювання ризику

Основні підходи до оцінки ризику: кількісний, комплексний, якісний. Математичні методи аналізу ризиків: статистичний, метод ігор, метод сценаріїв, метод аналогій, метод дерева рішень, метод коригування норми дисконту, імітаційне моделювання. Статистичний метод аналізу та оцінки ризику. Математичне очікування, дисперсія, середньоквадратичне відхилення, коефіцієнт варіації. Рівень «прийнятого ризику».

Тема 3. Крива економічного ризику

Ризик і прибуток. Взаємозв'язок прибутку і рівня ризику. Види втрат. Ризик і втрати. Зони та крива економічного ризику. Методи побудови кривої ризику.

Тема 4. Проектний ризик: його аналіз, оцінювання та моделювання.

Поняття проектний ризик та методи прогнозування ризику. Кількісний аналіз ризиків. Аналіз чутливості проекту. Аналіз сценаріїв розвитку проекту. Метод імітаційного моделювання. Моделювання ризику методом Монте-Карло

Тема 5. Ідентифікація та оцінювання фінансових та банківських ризиків

Виявлення та ідентифікація фінансових та банківських ризиків. Кількісні показники оцінювання фінансових та банківських ризиків. Математичні методи оцінювання ризиків. VaR – методологія кількісної оцінки ризику. Оцінювання складових факторів ризику валютного портфеля.

Тема 6. Управління ризиками.

Основи ризик-менеджменту. Сутність управління ризиками та історичні етапи формування загальних підходів до управління ризиками. Етапи формування ризик-менеджменту в Україні. Загальні методи управління ризиками: запобігання ризику; передача ризику; локалізація ризику; зниження ступеня ризику.

Тема 7. Сутність теорії прийняття рішень в умовах невизначеності та ризику

Наукові основи теорії прийняття рішень в умовах невизначеності та ризику. Класифікація управлінських рішень за типами, спрямованістю, відношенням до проблемної ситуації. Функції рішень та їх класифікація. Процес прийняття рішень. Технологія ухвалення рішень.

Тема 8. Моделі підтримки прийняття рішень в умовах невизначеності та ризику

Моделі підтримки прийняття рішень стратегічного управління в умовах ризику. Моделі підтримки прийняття рішень з фінансового менеджменту в умовах ризику (моделі беззбитковості, діагностики банкрутства). Моделі підтримки прийняття оптимального рішення з використанням теорії ігор в умовах ризику (критерії «максимальної вигоди» ,



критерій Ходжа-Лемана, критерій Лапласа, критерій Байєса-Лапласа, критерій песимізму-оптимізму (критерій Гурвіца), критерій оптимізму (критерій Севіджа, правило мінімакс), критерій песимізму (критерій Вальда, найбільшої обережності).

C. LIST OF COMPETENCIES AND STUDIES TARGETED RESULTS / ПЕРЕЛІК КОМПЕТЕНТНОСТЕЙ ТА ПРОГРАМНИХ РЕЗУЛЬТАТІВ НАВЧАННЯ

Загальні компетентності (ЗК)	ЗК3. Здатність до абстрактного мислення, аналізу, синтезу. ЗК4. Здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях. ЗК5. Знання та розуміння предметної області та розуміння професійної діяльності. ЗК8. Навички використання інформаційних і комунікаційних технологій. ЗК9. Здатність вчитися і оволодівати сучасними знаннями. ЗК10. Здатність до проведення досліджень на відповідному рівні. ЗК11. Здатність до адаптації та дії в новій ситуації. ЗК12. Здатність генерувати нові ідеї (креативність).
Спеціальні (фахові) компетентності (ФК)	СК1. Здатність визначати та описувати характеристики організації. СК2. Здатність аналізувати результати діяльності організації, з'являти їх з факторами впливу зовнішнього та внутрішнього середовища. СК4. Вміння визначати функціональні області організації та зв'язки між ними. СК6. Здатність діяти соціально відповідально і свідомо. СК7. Здатність обирати та використовувати сучасний інструментарій менеджменту. СК12. Здатність аналізувати й структурувати проблеми організації, формувати обґрунтовані рішення.
Програмні результати навчання (ПР)	ПР4. Демонструвати навички виявлення проблем та обґрунтування управлінських рішень. ПР5. Описувати зміст функціональних сфер діяльності організації. ПР6. Виявляти навички пошуку, збирання та аналізу інформації, розрахунку показників для обґрунтування управлінських рішень. ПР7. Виявляти навички організаційного проектування. ПР11. Демонструвати навички аналізу ситуації та здійснення комунікації у різних сферах діяльності організації. ПР12. Оцінювати правові, соціальні та економічні наслідки функціонування організації. ПР16. Демонструвати навички самостійної роботи, гнучкого мислення, відкритості до нових знань, бути критичним і самокритичним. ПР17. Виконувати дослідження індивідуально та/або в групі під керівництвом лідера.

D. SEMESTER PLAN / СЕМЕСТРОВИЙ ПЛАН

Вивчення дисципліни передбачає виконання однієї аудиторної контрольної (модульної) роботи у письмовій формі. Під час виконання студенти мають продемонструвати уміння та навички залучати набуті теоретичні знання до аналізу поставлених в роботі проблемних питань.

Вивчення дисципліни передбачає виконання індивідуальних завдань. Кожен студент індивідуально виконує наступне завдання:

Провести міні-дослідження на основі реальних даних діяльності підприємства (організації) зовнішніх та внутрішніх факторів ризику, визначити сильні та слабкі сторони, оцінити ймовірність його банкрутства, результати якого оформити у вигляді письмового звіту, представити у вигляді доповіді з презентацією та захистити.

Детальний план проведення практичних занять, завдання для практичних занять, самостійної та індивідуальної роботи містяться в системі MOODLE у наступних рекомендаціях:

1. Методичні рекомендації до практичних занять та самостійної роботи з курсу «Ризикологія»;
2. Методичні рекомендації для виконання індивідуальної роботи з курсу «Ризикологія».

E. BASIC LITERATURE (OBLIGATORY TEXTBOOKS) / ОСНОВНА ЛІТЕРАТУРА (ОБОВ'ЯЗКОВІ ПІДРУЧНИКИ)

1. Вітлінський В.В. Економічний ризик: ігрові моделі/ В.В. Вітлінський та ін. К.: КНЕУ, 2002. 446 с.
2. Вітлінський В.В., Великоіваненко Г.І. Ризикологія в економіці та підприємстві: Монографія. К.: КНЕУ, 2004. 480 с.
3. Вітлінський В.В., Верченко П.І. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком. К.: КНЕУ, 2000. 292 с.
4. Вітлінський В.В., Наконечний С.І. Ризик у менеджменті. К.: ТОВ «Борисфен-М», 1996. 336 с.
5. Івченко І.Ю. Економічні ризики. К.: Центр навчальної літератури, 2004. 304 с.
6. Кігель, В.Р. Методи і моделі підтримки прийняття рішень у ринковій економіці: монографія. К.:ЦУЛ, 2003. 202 с.
7. Клименко С.М., Дуброва О.С. Обґрунтування господарських рішень і оцінка ризиків: навч. посіб. для самостійного вивчення дисципліни. К.: КНЕУ, 2006. 188 с.
8. Кредитний ризик комерційного банку / за ред. В.В. Вітлінського. К.: Т-во «Знання» КОО, 2000. 215 с.
9. Лук'янова В.В., Голова Т.В. Економічний ризик: навч. посібник. К.: Академ-видав, 2007. 464 с.
10. Машина Н.І. Економічний ризик і методи його вимірювання. К.: Центр навчальної літератури, 2003. 188 с.
11. Пасічник В.Г., Аніліна О.В. Економічне обґрунтування господарських рішень. К.: Центр навчальної літератури, 2005. 144 с.



F. COMPLEMENTARY LITERATURE / ДОДАТКОВА ЛІТЕРАТУРА

12. Управління підприємницьким ризиком / за ред. Д.А. Штефаніча. Тернопіль: Економічна думка, 1999. 224 с.
13. Устенко О.Л. Теория экономического риска. К.: МАУП, 1997. 164 с.

Посилання на інформаційні ресурси в Інтернеті, відео-лекції, інше методичне забезпечення

1. GfK Ukraine. Звіти за дослідженнями. URL: http://www.gfk.ua/public_relations/useful_info/index.ua.html
2. Офіційний сайт державної служби статистики України. URL: <http://www.ukrstat.gov.ua/>.
3. Офіційний сайт департаменту статистики Організації Об'єднаних Націй. URL: <http://unstats.un.org/unsd/default.htm>.
4. Офіційний сайт Міжнародного валютного фонду. URL: <http://www.imf.org>.
5. Офіційний сайт Міністерства економічного розвитку та торгівлі України. URL: <http://me.kmu.gov.ua>.
6. Офіційний сайт Національного банку України. URL: <http://www.bank.gov.ua>.
7. Офіційний сайт Світового банку. URL: <http://web.worldbank.org>.

G. THE MOST IMPORTANT PUBLICATIONS OF THE AUTHOR(S) CONCERNING PROPOSED CLASSES / ОСНОВНІ ПУБЛІКАЦІЇ АВТОРА, ЩО ПОВ'ЯЗАНІ З ТЕМАТИКОЮ ЗАПЛАНОВАНИХ ЗАНЯТЬ

1. Inclusive Development of Ukraine: Problems and Prospects. (2022) In Proceedings of the 5th International Scientific Congress Society of Ambient Intelligence - ISC SAI, ISBN 978-989-758-600-2, pages 108-116. DOI: 10.5220/0011342200003350
2. E-COMMERCE IN UKRAINE: FUNDAMENTALS, TRENDS AND CURRENT ISSUES
3. Social and economic aspects of internet services market development: monograph 2021-02-26 | book-chapter
4. ISBN: 978-80-908066-9-6
5. Certificate - III International Scientific Conference "SOCIETY OF AMBIENT INTELLIGENCE" Ukraine-Uzbekistan-Latvia-Poland. COMPETITION OF YOUTH BUSINESS-PROJECTS AND START-UPS IN THE FRAMES | other SOURCE-WORK-ID: №293/2020 12-19.05.2020
6. Certificate - III International Scientific Conference "SOCIETY OF AMBIENT INTELLIGENCE" Ukraine-Uzbekistan-Latvia-Poland. Section 1. Business Models, Tools, and Innovations in Digital Economy | other SOURCE-WORK-ID: №497/2020 24-25.09.2020
7. Certificate - IV International Scientific Conference "Global Aspects of World Economy and International Relations in Conditions of Economic Instability" Czestochowa - Kryvyi Rih 2019 | other SOURCE-WORK-ID: №091/2019 11-12.04.2019
8. Modeling of trends of economic development under instability circumstances
9. GLOBALNE ASPEKTY EKONOMII ŚWIATOWEJ I STOSUNKÓW MIĘDZYNARODOWYCH W WARUNKACH NITSTABILNOŚCI GOSPODARSTWA: monografia Międzynarodowej Konferencji Naukowo-Praktycznej, Czestochowa, Akademia Polonijna 2016 | book-chapter
10. ISBN: 978-83-7542-168-2

H. PREREQUISITE AND POSTREQUISITE / ПРЕРЕКВІЗИТИ ТА ПОСТРЕКВІЗИТИ

Дисципліни, які є необхідними передумовами для вивчення зазначеного курсу: «Економічний аналіз», «Маркетинг», «Менеджмент», «Статистика», «Вища математика». Крім того, навчальна дисципліна базується на нормативних та за вибором навчальних дисциплінах і є необхідною для опанування подальших навчальних дисциплін тощо.

Обов'язкового знання іноземних мов не потребує

I. SCOPE AND TYPE / КІЛЬКІСТЬ ВІДВЕДЕНИХ ГОДИН ТА ФОРМА ПРОВЕДЕННЯ ЗАНЯТЬ

	Денна	Заочна
Лекції	20	10
Практичні (лабораторні)	20	8
Самостійна робота студента (СРС)	95	117
Індивідуально-консультативна робота (ІКР)	15	15
Курсова робота	–	–

J. CURRENT AND FINAL EVALUATION / ПОТОЧНЕ ТА ПІДСУМКОВЕ ОЦІНЮВАННЯ

	Денна	Заочна
Поточний контроль, в т.ч.:	50	50
оцінювання під час аудиторних занять	10	10
виконання контрольних (модульних) робіт	25	25
виконання і захист завдань самостійної роботи	10	10
науково-дослідницька робота	5	5
Підсумковий контроль (екзамен)	50	50
Разом	100	100

Шкала балів	Оцінка за 4-бальною шкалою	Шкала ECTS
90 – 100	Відмінно	A
80 – 89	Добре	B
70 – 79		C
66 – 69		D
60 – 65	Задовільно	E
21 – 59	незадовільно з можливістю повторного складання екзамену (заліку)	FX
0 – 20	незадовільно з можливістю вивчення дисципліни за індивідуальним графіком у формі додаткової індивідуально-консультативної роботи.	F

K. CODE OF CONDUCT OF THE COURSE / КОДЕКС ПОВЕДІНКИ ПІД ЧАС ВИВЧЕННЯ КУРСУ

Для успішного проходження курсу та складання контрольних заходів необхідним є виконання наступних обов'язків:

- ❖ не запізнюватися на заняття;
- ❖ не пропускати заняття (як лекційні, так і практичні), в разі хвороби мати довідку або її ксерокопію;
- ❖ самостійно опрацювати весь лекційний матеріал та ресурси для самостійної роботи;
- ❖ при підготовці есе, есе-рефлексії на статтю, що запропонована вам для читання (див. семестровий план), оцінюється якість та оригінальність наведених вами аргументів. Есе повинно бути надіслано до 16:00 у попередній день перед семінаром. Усі повинні обов'язково підготувати есе, а його відсутність з будь-яких причин не може бути виправданням.
- ❖ конструктивно підтримувати зворотній зв'язок з викладачем на всіх етапах проходження курсу (особливо під час виконання індивідуальних проєктів);
- ❖ своєчасно і самостійно виконувати всі передбачені програмою лабораторні та практичні завдання;
- ❖ брати очну участь у контрольних заходах;
- ❖ будь-яке відтворення результатів чужої праці (включаючи практичну роботу над командним проєктом), в тому числі використання завантажених з Інтернету матеріалів, як власних результатів, кваліфікується, як порушення норм і правил академічної доброчесності, та передбачає притягнення до відповідальності у порядку, визначеному чинним законодавством.

L. METHODS OF CONDUCTING / МЕТОДИ НАВЧАННЯ

Для формувань компетентностей застосовуються такі методи навчання:

вербальні/словесні (лекція, пояснення, розповідь, бесіда);
наочні (спостереження, ілюстрація, демонстрація);
практичні (різні види практичних завдань, вирішення кейсів, виконання графічних робіт, проведення експерименту, практики);
пояснювально-ілюстративний, який передбачає пред'явлення готової інформації викладачем та її засвоєння студентами;
метод проблемного викладу;
дослідницький.

M. TOOLS, EQUIPMENT AND SOFTWARE / ІНСТРУМЕНТИ, ОБЛАДНАННЯ ТА ПРОГРАМНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ

мультимедійний клас з ПК, цифровий проєктор

[Zoom](#) – хмарна платформа для відео і аудіо конференцій та вебінарів

ZELIS - система призначена для тестування знань студентів в двох режимах: автоматизований контроль знань та тестування по бланкам.

N. STUDENT RESOURCES, MOOC PLATFORMS / ЦИФРОВІ РЕСУРСИ ДЛЯ СТУДЕНТІВ ТА ВІДКРИТІ ДИСТАНЦІЙНІ ОНЛАЙН КУРСИ

Студентам пропонується доступ до навчальних матеріалів дисципліни - moodle.kneu.dp.ua:

[Coursera](#) – безкоштовні онлайн-курси з різних дисциплін, у разі успішного закінчення яких користувач отримує сертифікат про проходження курсу.

[EdX](#) – онлайн-курси від закладів вищої освіти.

[Prometheus](#) – український громадський проєкт масових відкритих онлайн-курсів.

O. FEEDBACK/ ЗВОРОТНІЙ ЗВ'ЯЗОК

Електронні листи є найкращим способом зв'язатися з керівником курсу, і, будь ласка, додайте шифр групи в темі листа. Якщо ви відправите мені електронне повідомлення, надайте мені 24 години, щоб відповісти. Якщо ви не отримаєте відповідь, протягом зазначеного терміну, відправте листа повторно.

P. ACADEMIC HONESTY/ АКАДЕМІЧНА ДОБРОЧЕСНІСТЬ

Державний університет економіки і технологій очікує від студентів розуміння та підтримання високих стандартів академічної чесності. Приклади академічної не доброчесності включають такі: плагіат, зловживання інформацією із застарілих джерел мережі. Очікується, що вся робота, виконана відповідно до вимог курсу, є власною роботою студента. Під час підготовки роботи, яка відповідає вимогам курсу, студенти повинні відрізнити власні ідеї від



інформації, отриманої з інших джерел.

Політика щодо академічної доброчесності в Державному університеті економіки та технологій регламентується Положенням про академічну доброчесність (Затвердженим Вченою радою ДУЕТ, Протокол №5 від 28.01.2021 р).

APPROVED / ЗАТВЕРДЖЕНО

Укладач

ЗАТВЕРДЖЕНО:

Кафедрою управління бізнесом
Протокол № 8 від 10 січня 2023 року
В.о. завідувача кафедри

Науково-методичною радою Державного університету
економіки і технологій
Протокол № 7 від 25 січня 2023 року

Віта МАКАРЕНКО

Тетяна ПЕТРИШИНА