

	Центральноукраїнський державний університет імені Володимира Винниченка	Силабус навчальної дисципліни			
		Назва дисципліни Ризикологія (аналіз та моделювання економічного ризику)			
		Статус дисципліни <i>Нормативна</i>			
Галузь знань	05 Соціальні та поведінкові науки				
Спеціальність	051 Економіка				
Освітня програма	Економічна безпека				
Рівень вищої освіти	Бакалавр				
Форма навчання	Денна				
Курс	Третій				
Семестр	Шостий				
Обсяг дисципліни	Кредити	5,0	Години	150	
	Лекційні			36 (14 заочна)	
	Практичні/семінарські			32 (10 заочна)	
	Лабораторні				
	Самостійна робота			82 (126 заочна)	
Семестровий контроль	Екзамен				
Викладач	<i>Левченко О.М., доктор.економ. наук, професор</i>				
Контактна інформація	O.M.Levchenko@cuspu.edu.ua				
Кафедра	<i>Менеджменту та підприємництва</i>				
Факультет	<i>Математики, природничих наук та технологій</i>				
Предмет навчання (Що буде вивчатися)	Предметом освітньої компоненти Ризикологія (аналіз та моделювання економічного ризику) є теоретичні і практичні питання аналізу економічного ризику, математичні методи і моделювання поведінки економічних систем з урахуванням ризику.				
Мета (Чому це цікаво/потрібно вивчати)	<p>Мета викладання навчальної дисципліни - навчити майбутніх фахівців теорії економічних ризиків, методів їхвимірювання, прийомів зниження ступеня економічного ризику з урахуваннямзовнішніх та внутрішніх чинників розвитку підприємства, методів прогнозуваннякінцевого результату і вибору оптимальної стратегії підприємства в умовахневизначеності, випадковості та конфліктності.</p> <p>Головними завданнями курсу є:</p> <ul style="list-style-type: none"> ➤ надання цілісної системи наукових знань у сфері теорії та практики ➤ оцінки та управління економічними ризиками; ➤ вміння використовувати отриманні теоретичні знання при управлінні ➤ економічними ризиками у практичних ситуаціях; ➤ оволодіння новітніми управлінськими підходами та застосування ➤ сучасних науково-технічних досягнень в процесі прийняття управлінських рішень; 				
Компетентності	Загальні компетентності (ЗК)				

	<p>ЗК4. Здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях.</p> <p>ЗК8. Здатність до пошуку, оброблення та аналізу інформації з різних джерел.</p> <p>ЗК10. Здатність бути критичним і самокритичним.</p> <p>Спеціальні (фахові предметні) компетентності (СК)</p> <p>ФК4. Здатність пояснювати економічні та соціальні процеси і явища на основі теоретичних моделей, аналізувати і змістовно інтерпретувати отримані результати.</p> <p>ФК9. Здатність прогнозувати на основі стандартних теоретичних та економетричних моделей соціально-економічні процеси.</p> <p>ФК14. Здатність поглиблено аналізувати проблеми і явища в одній або декількох професійних сферах з врахуванням економічних ризиків та можливих соціально-економічних наслідків.</p>
<p>Програмні результати (Чому можна навчитися)</p>	<p><i>У результаті вивчення навчальної дисципліни студенти зможуть:</i></p> <p>ПРН6. Використовувати професійну аргументацію для донесення інформації, ідей, проблем та способів їх вирішення до фахівців і нефахівців у сфері економічної діяльності.</p> <p>ПРН12. Застосовувати набуті теоретичні знання для розв'язання практичних завдань та змістовно інтерпретувати отримані результати.</p> <p>ПРН16. Вміти використовувати дані, надавати аргументацію, критично оцінювати логіку та формувати висновки з наукових та аналітичних текстів з економіки.</p> <p>ПРН17. Виконувати міждисциплінарний аналіз соціально-економічних явищ і проблем в однієї або декількох професійних сферах з врахуванням ризиків та можливих соціально-економічних наслідків.</p>
<p>Зміст дисципліни</p>	<p>Змістовий модуль 1 Теоретичні основи ризикології</p> <p>Тема 1. Концептуальні засади ризикології в економіці та підприємстві</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Предмет та завдання дисципліни «Ризикологія». 2. Еволюція поглядів на феномен ризику. 3. Концептуальні засади ризикології. 4. Актуальні проблеми ризикології <p>Тема 2. Сутнісна характеристика економічних ризиків та джерел їх виникнення.</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Невизначеність та її види. 2. Особливості управління підприємством в умовах невизначеності. 3. Зв'язок невизначеності та ризику. 4. Сутність економічного ризику. 5. Суб'єкт, об'єкт та джерела економічного ризику. 6. Фактори, які впливають на рівень економічного ризику. <p>Тема 3. Класифікація ризиків та їх сутність.</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Критерії та принципи класифікації економічних ризиків. 2. Характеристика видів ризику в деяких сферах економічної діяльності. 3. Функції ризику. <p>Тема 4. Ризик-менеджмент.</p>

1. Зміст управління економічним ризиком.
2. Сутність та функції ризик-менеджменту.
3. Етапи управління кризовою ситуацією на підприємстві.

Тема 5. Способи зниження рівня економічного ризику на підприємстві.

1. Контроль над ризиком.
2. Фінансування ризиків.
3. Запаси і резерви як спосіб зниження ризиків.
4. Роль інформації в ризик-менеджменті.

Тема 6. Засади системного аналізу ризику в спектрі економічних проблем

1. Системний аналіз ризику в економіці та підприємстві.
2. Принципи аналізу ризику.
3. Якісний та кількісний аналіз ризику.
4. Абсолютні та відносні показники економічного ризику.
5. Загальні підходи до аналізу ризику.

Змістовний модуль 2. Методологічні основи вимірювання економічного ризику та кількісної оцінки окремих його видів

Тема 7. Система кількісних оцінок економічного ризику

1. Загальні підходи до аналізу кількісних оцінок ризику.
2. Оцінка ступеня ризику в абсолютному виразі.
3. Оцінка ступеня ризику у відносному виразі.
4. Ризик та нерівність Чебишева.
5. Правило „трех сігм”.
6. Поняття допустимого, критичного та катастрофічного ризиків.
7. Переваги кількісного аналізу ризику.

Тема 8. Використання теорії ігор в кількісній оцінці ризиків.

1. Завдання теорії ігор.
2. Сутність теоретико-ігрової моделі.
3. Оптимальна стратегія.
4. Сутність статистичного методу.
5. Критерії та визначення ступеня та міри економічного ризику.
6. Використання методу дерева рішень для управління ризиками.
7. Метод аналізу доцільності витрат, його сутність, переваги та недоліки.
8. Сутність та значення методу експертних оцінок.
9. Сутність, основні етапи та умови застосування методу аналогів.
10. Сутність аналітичного методу.
11. Сутність методу аналізу чутливості.
12. Метод аналізу сценаріїв та його сутність.
13. Імітаційне моделювання в оцінці економічних ризиків.

Тема 9. Виробничі ризики та особливості їх оцінки.

1. Сутність виробничих ризиків підприємства.
2. Технічні, безпосередньо виробничі, постачальницькі ризики: їх характеристика та джерела виникнення.

	<p>3. Транспортні ризики та їх види. 4. Кількісна оцінка виробничих ризиків та їх оцінка.</p> <p>Тема 10. Фінансові ризики та особливості їх оцінки</p> <p>1. Сутність та характеристика фінансових ризиків. 2. Види фінансових ризиків. 3. Аналіз та оцінка фінансових ризиків. 4. Методи зниження фінансового ризику</p> <p>Тема 11. Інвестиційні ризики та особливості їх оцінки</p> <p>1. Сутність інвестиційних ризиків. 2. Види ризиків при оцінці проектів. 3. Методи аналізу ризиків проектів. 4. Аналіз чутливості проекту. 5. Перевірка стійкості проекту. 6. Аналіз альтернативних сценаріїв розвитку проекту. 7. Оцінка ризику країни в рамках прийняття інвестиційних рішень</p> <p>Тема 12. Основні способи регулювання ризиків на макрорівні</p> <p>1. Характеристика основних способів зниження ризиків: страхування, резервування, лімітування. 2. Система вибору партнерів. 3. Інструменти оптимізації ризиків.</p>
--	--

<p>Критерії оцінювання роботи студентів</p>	<p>Критеріями оцінки є: <i>усні відповіді:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> • Повнота розкриття питання; • Логіка викладання, культура мови; • Емоційність та переконаність; • Використання основної та додаткової літератури; • Аналітичні міркування, уміння робити порівняння, висновки; <p><i>виконання письмових (практичних та аналітично-розрахункових), тестових завдань:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> • Повнота розкриття; • Правильність розв'язання; • Цілісність, системність, логічність, уміння формулювати висновки; • Акуратність оформлення роботи. <p><i>Критерії оцінювання під час аудиторних занять.</i> Досягнення студентів на практичних заняттях, а також виконані ними індивідуальної та самостійної роботи оцінюються за шкалою від «0» до «5». Критерії оцінювання наводяться у таблиці.</p> <p>Критерії оцінювання навчальних досягнень студентів на практичних заняттях</p> <table border="1" data-bbox="683 1794 1560 2056"> <thead> <tr> <th data-bbox="683 1794 869 1832"><i>Оцінка</i></th> <th data-bbox="869 1794 1560 1832"><i>Критерії оцінювання навчальних досягнень</i></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="683 1832 869 2056">5 балів</td> <td data-bbox="869 1832 1560 2056">Оцінюється робота студента, який у повному обсязі володіє навчальним матеріалом, вільно, самостійно й аргументовано його викладає, глибоко та всебічно розкриває зміст теоретичних запитань та практичних завдань, використовуючи при цьому обов'язкову та</td> </tr> </tbody> </table>	<i>Оцінка</i>	<i>Критерії оцінювання навчальних досягнень</i>	5 балів	Оцінюється робота студента, який у повному обсязі володіє навчальним матеріалом, вільно, самостійно й аргументовано його викладає, глибоко та всебічно розкриває зміст теоретичних запитань та практичних завдань, використовуючи при цьому обов'язкову та
<i>Оцінка</i>	<i>Критерії оцінювання навчальних досягнень</i>				
5 балів	Оцінюється робота студента, який у повному обсязі володіє навчальним матеріалом, вільно, самостійно й аргументовано його викладає, глибоко та всебічно розкриває зміст теоретичних запитань та практичних завдань, використовуючи при цьому обов'язкову та				

	<p>додаткову літературу, вільно послуговується науковою термінологією, розв'язує задачі стандартним або оригінальним способом, наводить аргументи на підтвердження власних думок, здійснює аналіз та робить висновки.</p>
4 бали	<p>Оцінюється робота студента, який достатньо повно володіє навчальним матеріалом, обґрунтовано його викладає, в основному розкриває зміст теоретичних запитань та практичних завдань, використовуючи при цьому обов'язкову літературу, послуговується науковою термінологією. Але при висвітленні деяких питань не вистачає достатньої глибини та аргументації, допускаються при цьому окремі неістотні неточності та незначні помилки.</p>
3 бали	<p>Оцінюється робота студента, який відтворює значну частину навчального матеріалу, висвітлює його основний зміст, виявляє елементарні знання окремих положень. Однак не здатний до глибокого, всебічного аналізу, обґрунтування та аргументації, не користується необхідною літературою, допускає істотні неточності та помилки.</p>
2 бали	<p>Оцінюється робота студента, який достатньо не володіє навчальним матеріалом, однак фрагментарно, поверхово (без аргументації й обґрунтування) викладає окремі питання навчальної дисципліни, не розкриває зміст теоретичних питань і практичних завдань.</p>
1 бал	<p>Оцінюється робота студента, який не в змозі викласти зміст більшості питань теми та курсу, володіє навчальним матеріалом на рівні розпізнавання явищ, допускає істотні помилки, відповідає на запитання, що потребують однослівної відповіді.</p>
0 балів	<p>Оцінюється робота студента, який не володіє навчальним матеріалом та не в змозі його висвітлити, не розуміє змісту теоретичних питань та практичних завдань.</p>
<p>Підсумковий контроль знань здобувачів з дисципліни «Ризикологія» проводиться за результатами рейтингової оцінки за увесь період вивчення даної дисципліни та у формі екзамену. У разі невиконання завдань поточного контролю студент має право скласти їх індивідуально до останнього практичного заняття. Порядок такого контролю регламентований викладачем.</p>	

Схема нарахування балів, які отримують студенти

Поточне тестування та самостійна робота												Контрольна (5 балів з коефіцієнтом 2)	Реферат (доповідь)	Разом	Макс.	Сума
Розділ 1																
Теми																
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12					
4	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4	10	2	60	40	100

T1, T2 ... T7 – теми. За кожною темою здається тестовий контроль і перевіряється д/з.

Шкала оцінювання: національна та ЄКТС

Сума балів за всі види навчальної діяльності	Оцінка за національною шкалою	
	для екзамену, курсового проєкту (роботи), практики	для заліку
90-100	відмінно	зараховано
82-89	добре	
74-81		
64-73	задовільно	
60-63		
35-59	незадовільно	незараховано
1-34	незадовільно	незараховано

Політика курсу

Політика дотримання академічної доброчесності. Політика щодо пропусків занять. Політика щодо виконання завдань пізніше встановленого терміну: роботи, які здаються із порушенням термінів без поважних причин, оцінюються на нижчу оцінку (-20%). Політика навчальної дисципліни вибудовується з урахуванням норм чинного законодавства України та нормативних документів Університету. Викладання навчальної дисципліни ґрунтується на засадах академічної доброчесності, викладених у нормативних документах університету.

Інформаційне забезпечення

Рекомендована література Основна література

1. Стешенко О. Д. Ризикологія: Навч. посібник. Харків: УкрДУЗТ, 2019. 180 с.
2. Економічні ризики: методи вимірювання та управління : навчальний посібник / Н. С. Скопенко, І. В. Федуллова, Л. В. Мазник, О. М. Кириченко, Л. І. Удворгелі ; за заг. ред. Н. С. Скопенко. – Київ : Видавничий дім «Кондор»,

2021. – 348 с.

3. Економічні ризики: методи вимірювання та управління: Навчальний посібник / Скопенко Н.С., Федулова І.В., Мазник Л.В., Кириченко О.М., Удворгелі Л.І.; за заг. ред. Скопенко Н.С. К. : НУХТ, 2021. 344 с. URL: <https://dspace.nuft.edu.ua/server/api/core/bitstreams/ad3cf033-6858-4e2fb001-85f9b3dc0d8f/content>
4. Полінкевич О. М., Волинець І. Г. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання ризиків: навч. посіб. Луцьк : Вежа-Друк, 2018. 336 с. URL: http://www.esnuir.eenu.edu.ua/bitstream/123456789/15846/1/Polinkevych_Volynets_OGROR2018.pdf
5. Старостіна А.О., Кравченко В.А. Ризик-менеджмент: теорія та практика: навч. посіб. К.: ІВЦ “Видавництво «Політехніка»”, 2018. 200 с.

Допоміжна література

1. Кігель В.Р. Ризикологія: теоретичні основи та прикладні задачі, моделі і методи [Навчальний посібник для студентів економічних спеціальностей]. — К.: Міленіум, 2017. - 230 с.
2. Управління фінансовими ризиками : навч. посібник / Куцик П. О., У67 Васильців Т. Г., Сороківський В. М., Стефаняк В. І., Сороківська М. В. - Львів : Растр-7, 2016. - 318 с.
3. Фінансово-економічна грамотність: Підручник: у 2 частинах. Частина 1.: Основи національної економіки, економіки регіонів та фінансової системи України./ авт. кол.; за редакцією д-ра екон. наук, проф. Жихор О.Б., д-ра екон. наук, проф. Димченко О.В. – К.: Кондор, 2017. - 1024 с.
4. Федулова І. В., Скопенко Н.С. Економічні ризики та методи їх вимірювання : навч. посібник. К : Принтцентр, 2016. 298с.

Інформаційні ресурси

1. management.com.ua – бібліотека з менеджменту
2. inform.od.ua – нормативні акти у сфері управління
3. <http://window.edu.ru> – єдине вікно доступу до освітніх ресурсів
5. <http://www.profibook.com.ua> – ділова література з економіки, менеджменту, реклами і маркетингу, управління персоналом, психології бізнесу, інформаційних технологій і т.д.
6. <http://www.airn.net> – Internet-банкінг, Internet-страхування, Internet- маркетинг, електронна комерція, міжнародний бізнес, робота на фондових ринках
7. <http://www.kmci.com.ua> – бізнес-рішення для розвитку підприємств, управління маркетингом і збутом, фінансовий менеджмент, управління персоналом, інформаційні технології управління персоналом, бюджетування.
8. Законодавчі та нормативні акти України. – Режим

	<p>доступу :www.zakon.com.</p> <p>9. Офіційний сайт Кабінету міністрів України. – Режим доступу :www.kmu.gov.ua</p> <p>10. Офіційний сайт Державного комітету статистики України. – Режим доступу: www.ukrstat.gov.ua.</p> <p>11. https://kneu.edu.ua/ua/science_kneu/periodic/ekon_pidpr – електронна версія збірника наукових праць «Економіка та підприємництво». http://www.imf.org.</p> <p>12. http://kodeksy.com.ua/ – Закони і кодекси України.</p> <p>13. Сайт Право. Україна. – Режим доступу :www.legal.com.ua.</p>
Матеріально-технічне забезпечення	Аудиторія теоретичного навчання, оснащена сучасним комп'ютерним обладнанням, з використанням офісного пакету Microsoft Office (Word, Excel, PowerPoint), проектор, ноутбук, наукова література, презентаційні матеріали.