



МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ЦЕНТРАЛЬНОУКРАЇНСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ
ТЕХНІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ



Кафедра економічної теорії, маркетингу та економічної
кібернетики

СИЛАБУС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Назва курсу	РИЗИКОЛОГІЯ
Викладач 	Вікторія ВИШНЕВСЬКА, кандидат економічних наук, доцент, доцент кафедри економічної теорії, маркетингу та економічної кібернетики
Контактний тел.	+38(066) 034 80 90
Е-mail:	vyshnevskava@kntu.kr.ua
Обсяг та ознаки дисципліни	Вибіркова дисципліна. Форма контролю: залік. Загальна кількість кредитів – 4, годин – 120, у т.ч. лекції – 18 годин, практичні заняття – 18 годин, самостійна робота – 84 години. Формат: очний (offline / face to face) / дистанційний (online). Мова викладання: українська. Рік викладання – 2023.
Консультації	Консультації проводяться відповідно до Графіку, розміщеному в інформаційному ресурсі moodle.kntu.kr.ua; у режимі відеоконференцій Zoom, через електронну пошту, Viber, Messenger, Telegram за домовленістю.
Пререквізити	Базові знання з економічної теорії, мікроекономіки, макроекономіки, економіки підприємства.

1. Мета і завдання дисципліни

Метою вивчення навчальної дисципліни «Ризикологія» є формування у здобувачів системи знань щодо сутності та функцій економічних ризиків, причин його виникнення, методів оцінки та виміру ризику у різних сферах діяльності, практичним способом запобігання прояву ризиків та зменшення негативних наслідків їх дії на результати діяльності підприємства, визначенню напрямів та методів управління економічним ризиком в діяльності підприємства.

Завдання вивчення дисципліни:

- формування у здобувачів відповідного рівня знань, які б дали їм можливість класифікувати види ризиків за причинами їх виникнення, підбирати методи кількісної оцінки, прийнятні для кожного з видів;
- отримання здобувачами теоретичної та практичної підготовки з питань зниження ризиків;
- засвоєння основних методів і моделей прийняття багатоцільових рішень за умов невизначеності та ризику;
- розвиток уміння застосовувати методи управління ризиком на вітчизняних підприємствах.

2. Результати навчання

У результаті вивчення навчальної дисципліни здобувач вищої освіти повинен

знати: принципи раціональної поведінки в умовах, що обтяжені ризиком, методи виявлення джерел ризику, класифікувати різні типи ризиків, сутність основних принципів щодо аналізу, кількісної оцінки ступеня ризику, методи його зниження до допустимого рівня;

вміти: самостійно здійснювати аналіз ризику як на якісному так і на кількісному рівні, оцінювати його ступінь, враховувати його, керувати ризиком, застосовуючи методи адекватні цілям та прийнятій системі гіпотез у фінансово-кредитній сфері і зовнішньоекономічній діяльності.

набути соціальних навичок (soft-skills):

- здійснювати професійну комунікацію, ефективно пояснювати і презентувати матеріал;
- взаємодіяти в економічному середовищі.

3. Політика курсу та академічна доброчесність

Очікується, що здобувачі вищої освіти будуть дотримуватися принципів академічної доброчесності, усвідомлювати наслідки її порушення.

При організації освітнього процесу в Центральноукраїнському національному технічному університеті здобувачі вищої освіти, викладачі та адміністрація діють відповідно до: Положення про організацію освітнього процесу; Положення про організацію вивчення вибіркового навчальних дисциплін та формування індивідуального навчального плану ЗВО; Кодексу академічної доброчесності ЦНТУ.

4. Програма навчальної дисципліни

Тема 1. Ризик та його ключові характеристики

Тема 2. Ризик та елементи теорії корисності

Тема 3. Вимірювання ризику (імовірнісний підхід)

Тема 4. Методи кількісного аналізу ризику

Тема 5. Метод аналізу ризику за допомогою дерева рішень

Тема 6. Управління економічним ризиком

Тема 7. Диверсифікація як спосіб зниження ступеня ризику. Теорія портфеля

Тема 8. Запаси та резерви як способи зниження ступеня ризику

Тема 9. Прикладні аспекти врахування ризику окремих видів економічної діяльності

5. Система оцінювання та вимоги

Види контролю: поточний, підсумковий.

Методи контролю: спостереження за навчальною діяльністю здобувачів, усне опитування, письмовий контроль.

Рейтинг студента із засвоєння дисципліни визначається за 100 бальною шкалою, у тому числі: перший рубіжний контроль – 50 балів, другий рубіжний контроль – 50 балів.

Семестровий залік полягає в оцінці рівня засвоєння здобувачем вищої освіти навчального матеріалу на лекційних та практичних заняттях і виконання індивідуальних завдань за стобальною та дворівневою («зараховано», «не зараховано») та шкалою ЄКТС результатів навчання.

6. Рекомендована література

Базова

1. Балджи М.Д. Економічний ризик та методи його вимірювання : навч. посіб. Харків : Промарт, 2015. 300 с.

2. Економічний ризик: методи оцінки та управління : 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.

3. Кучеренко В.Р., Карпов В.А., Карпов А.В. Економічний ризик та методи його вимірювання : навч. посіб. Одеса, 2017. 200 с.

4. Кігель В.Р. Ризикологія: теоретичні основи та прикладні задачі, моделі і методи: Навчальний посібник для студентів економічних спеціальностей. Київ : Міленіум, 2017. 230 с.

5. Стешенко О. Д. Ризикологія : Навч. посібник. Харків : УкрДУЗТ, 2019. 180 с.

6. David Vose. Risk Analysis: A Quantitative Guide. 3rd edition. Wiley, 2018. 752 p.

7. Douglas W. Hubbard. The Failure of Risk Management: Why It's Broken and How to Fix It. 2nd edition. Wiley, 2020. 336 p.

Допоміжна

8. Балджи М.Д., Карпов В.А., Ковальов А.І., Костусев О.О., Котова І.М., Сментина Н.В. Обґрунтування господарських рішень та оцінка ризиків : Навчальний посібник. Одеса: ОНЕУ, 2016. 670 с.

9. Бугрова О. Методологічні основи оцінки ризику при прийнятті інвестиційних рішень. *Економіка України*. 2018. № 10. С. 29–32.

10. Вітлінський В.В., Великоіваненко Г.І. Ризикологія в економіці та підприємстві : монографія. Київ : КНЕУ, 2004. 480 с.

11. Вітлінський В.В., Верченко П.І. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком : Навч.-метод. посібник для самост. вивч. дисц. Київ : КНЕУ, 2000. 292 с.

12. Вишневська В. А., Ніколаєв І. В. Вплив ризиків на показники ефективності діяльності промислових підприємств. *Наукові праці Кіровоградського національного технічного університету. Економічні науки*. 2018. Вип. 33. С. 211–218.

13. Економічний ризик: ігрові моделі : Навч. посібник / В.В. Вітлінський, П.І. Верченко, А.В. Сігал, Я.С. Наконечний; За ред. В.В. Вітлінського. Київ : КНЕУ, 2002. 446 с.

14. Жовновач Р. І., Вишневська В. А. Особливості оцінки та управління екологічними ризиками на металургійних підприємствах. *Центральноукраїнський науковий вісник. Економічні науки*. 2019. Кропивницький : ЦНТУ. Вип.3 (36). С. 261-270.

15. Івченко І.Ю. Економічні ризики : Навч. посібник Київ : Центр навчальної літератури, 2015. 304 с.

16. Івченко І.Ю. Моделювання економічних ризиків і ризикових ситуацій : навч. посіб. Київ : Центр учбової літератури, 2017. 344 с.

17. Ілляшенко С.М. Економічний ризик : Навч. посіб. Київ : Центр навчальної літератури, 2014. 220 с.

18. Клебанова Т.С., Раєвнева Е.В. Теория экономического риска : Учеб. – метод. пособие для самост. изучен. дисц. Харьков : Издательский дом «ИНЖЭК», 2003. 156 с.

19. Лещинський О. Л., Школьний О. В. Економічний ризик та методи його вимірювання : Навчальний посібник для студентів вищих навчальних закладів. Київ : Дельта, 2015. 112 с.

20. Лук'янова В.В., Головач Т.В. Економічний ризик : навч. посіб. Київ : Академвидав, 2007. 464 с.

21. Машина Н. І. Економічний ризик і методи його вимірювання : навч. посіб. Київ : Центр навчальної літератури, 2018. 188 с.

22. Останкова Л.А., Шевченко Н.Ю. Аналіз, моделювання та управління економічними ризиками : навч. посіб. Київ : ЦУЛ, 2017. 256 с.

23. Подсолонко Е.А. Менеджмент: теорія та практика : навч. посіб. Київ : ЦУЛ, 2015. 370 с.

24. Посохов І.М. Управління ризиками у підприємстві : навч. посіб. Харків : НТУ «ХП», 2015. 220 с.

25. Старостіна А. О., Кравченко В. А. Ризик-менеджмент : теорія та практика : Навч. посіб. Київ : ІВЦ „Видавництво „Політехніка”, 2015. 200 с.

26. Управління фінансовими ризиками : навч. посіб. / Куцик П.О., Васильців Т.Г., Сороківський В.М., Стефаняк В.І., Сороківська М.В. Львів : Растр-7, 2016. 318 с.

27. Н. Felix Kloman. Integrated Risk Assessment. Current Views of Risk Management. URL: [http:// www.garp.com](http://www.garp.com).

28. Davis E. Debt, Financial Fragility and systemic Risk. Oxford, 2015.

29. Michael Rees. Business Risk and Simulation Modelling in Practice: Using Excel, VBA and @RISK. 1st Edition. The Wiley Finance Series, 2015. 464 p.

30. Norman Marks. World-Class Risk Management. CreateSpace Independent Publishing Platform, 2015. 234 p.

Інформаційні ресурси

27. URL <http://zakon4.rada.gov.ua/laws> - Законодавство України.

28. URL <http://www.nbuv.gov.ua> – Офіційний сайт Національної бібліотеки України імені В.І. Вернадського.

29. URL: <http://www.ukrstat.gov.ua> - Офіційний сайт Державної служби статистики України

Розглянуто і схвалено на засіданні кафедри економічної теорії, маркетингу та економічної кібернетики, Протокол №1 від «15» серпня 2022 р.