




МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ЦЕНТРАЛЬНОУКРАЇНСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ
ТЕХНІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ

Кафедра економічної теорії, маркетингу та
економічної кібернетики



СИЛАБУС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Назва курсу	Управління ризиком в реальному секторі економіки
Викладач 	Руслана ЖОВНОВАЧ, доктор економічних наук, професор, завідувач кафедри економічної теорії, маркетингу та економічної кібернетики
Контактний тел.	+38(050)972-78-73
Е-mail:	ruslanaz1977@gmail.com
Обсяг та ознаки дисципліни	Вибіркова дисципліна. Форма контролю: залік. Загальна кількість кредитів – 4, годин – 120. Формат: очний (offline / face to face) / дистанційний (online). Мова викладання: українська. Рік викладання – 2023/2024.
Консультації	Консультації проводяться відповідно до Графіку, у т.ч. у режимі відеоконференцій Zoom, через електронну пошту, Viber, Messenger, Telegram за домовленістю.
Пререквізити	Особливі вимоги відсутні.

1. Мета і завдання дисципліни

Метою дисципліни «Управління ризиком в реальному секторі економіки» є формування 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 дисципліни передбачають:

- розширення та поглиблення знань про якісні та кількісні властивості управління економічними процесами з урахуванням ризику – характерного чинника сучасної економіки;
- вивчення низки найбільш типових прийомів моделювання та управління економічним ризиком у процесі прийняття рішень, опанування відповідним апаратом (методи, моделі, інформаційне та програмно-методичне комп'ютерне забезпечення) з метою практичного використання в реальному секторі економіки.

2. Результати навчання

У результаті вивчення навчальної дисципліни здобувач повинен:

знати:

- поняття економічного ризику та класифікацію ризиків в діяльності підприємства;
- джерела та сторони прояву ризику, його функції;
- загальні підходи до виміру й аналізу ризиків, алгоритму прийняття управлінського рішення в умовах неминучого вибору в умовах ризику;
- концептуальні засади, цілі і завдання використання методів і технології управління ризиками;
- методи аналізу та моделювання ризику в інвестиційній та фінансовій діяльності підприємства;
- сутність та природу виникнення ризиків у виробничій діяльності підприємства;
- методи управління ризиками та запобігання проявам ризиків у господарській діяльності підприємства.
- принципи ризик –менеджменту;
- методи оцінки ризику, визначати наслідки та ймовірності їх настання у майбутньому, встановлення факторів, що визначають ризик та елементи процесу ризик-менеджменту.

вміти:

- ідентифікувати ризики підприємства, визначати їх причини та джерела

виникнення;

- оцінювати ризики діяльності підприємства, використовуючи різні методи;

- кількісно виміряти ризик на основі статистичних оцінок;

- оцінити ризики прийняття рішень у виробничій діяльності підприємства;

- оволодіти підходами до управління ризиком та зниження його негативних проявів /наслідків в господарській діяльності підприємства.

- ефективно управляти ризиками, вибирати методи для оптимізації ризиків;

- формувати програму управління ризиками підприємств, складати стратегічну карту ризиків.

- вести наукові дослідження і забезпечувати їх презентацію.

набути соціальних навичок (soft-skills):

- розвинути креативне мислення та емоційний інтелект;

- розвинути вміння формувати власну думку та приймати обґрунтовані рішення;

- здатність обґрунтовувати власну точку зору на розв'язуване завдання керування на основі використання методів наукового пізнання, математичного моделювання, сучасного економіко-математичного інструментарію;

- забезпечувати комунікацію, ефективно пояснювати і презентувати матеріал, взаємодіяти в команді.

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

4. Програма навчальної дисципліни

Тема 1. Ризик та основні принципи його аналізу та управління

Тема 2. Система кількісних оцінок ступеня ризику

Тема 3. Управління економічним ризиком

Тема 4. Запаси та резерви як способи зниження ступеня ризику

Тема 5. Диверсифікація як спосіб зниження ступеня ризику. Теорія портфеля

Тема 6. Формування стратегії управління ризиком

- Тема 7. Вартість, час та ризик
Тема 8. Типові задачі урахування ризику у фінансовому менеджменті
Тема 9. Прикладні аспекти врахування ризику окремих видів економічної діяльності
Тема 10. Оцінка економічної безпеки підприємства

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 модуль – 50 балів, другий модуль – 50 балів.

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

6. Рекомендована література

Основна:

1. Балусєва О.В., Гончаров В.М., Ларіна Р.Р. Управління ризиками в логістиці. Навч. посіб. Київ : Кондор. 2019.
2. Лактіонова О. А. Управління фінансовими ризиками: навч. посіб. Вінниця : ДонНУ імені Василя Стуса, 2020.
3. Калініченко З.Д. Ризик-менеджмент: навч. посіб. для здобувачів спец. 051 «Економіка» та 073 «Менеджмент». Дніпро : ДДУВС, 2021. 224 с.
4. Кузьмін О. Є. та ін. Управління ризиками в інноваційній діяльності. навч. посіб. Друге видання, перероблене і доповнене / О.Є. Кузьмін, Н.Ю. Подольчак, Н.І. Подольчак., Л.Г. Вербицька. Львів : Видавництво Львівської політехніки, 2020. 240 с.
5. Мороз В.М., Мороз С.А. Ризик-менеджмент : навч. посіб. для студ. спец. 281 «Публічне управління та адміністрування». Харків : НТУ «ХП», 2018. 140 с.
6. Стешенко О. Д. Ризикологія: навч. посібник. Харків: УкрДУЗТ, 2019. 180 с.
7. Старостіна А. О., Кравченко В. А. Ризик-менеджмент : теорія та практика : навч. посіб. Київ : ІВЦ Видавництво «Політехніка», 2018. 200 с.
8. Beck U. Risk Society. Towards a New Moderning. London, 2022. 298 p.
9. David Vose. Risk Analysis: A Quantitative Guide. 3rd edition. Wiley, 2018. 752 p.
10. Douglas W. Hubbard. The Failure of Risk Management: Why It's Broken and How to Fix It. 2nd edition. Wiley, 2020. 336 p.
11. James Lam Implementing Enterprise Risk Management: From Methods to

Додаткова:

1. Артими-Дрогомирецька З.Б., Негрей М.В. Економічний ризик : навч.-метод. посіб. Львів: «Магнолія», 2019. 320 с.
2. Балджи М.Д., Карпов В.А., Ковальов А.І., Костусев О.О., Котова І.М., Сментина Н.В. Обґрунтування господарських рішень та оцінка ризиків : навч. посіб. Одеса: ОНЕУ, 2016. 670 с.
3. Балджи М.Д. Економічний ризик та методи його вимірювання : навч. посіб. Харків : Промарт, 2015. 300 с.
4. Вітлінський В.В., Великоіваненко Г.І. Ризикологія в економіці та підприємстві : *монографія*. Київ : КНЕУ, 2004. 480 с.
5. 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.
6. 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.
7. 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.
8. Ілляшенко С.М. Економічний ризик : навч. посіб. 2-ге вид., доп. і перероб. Київ : Центр навчальної літератури, 2017. 220 с.
9. Кондрашихін А.Б. Теорія та практика підприємницького ризику. навч. посіб. Київ: ЦУЛ, 2019. 224 с.
10. Кучеренко В.Р., Карпов В.А., Карпов А.В. Економічний ризик та методи його вимірювання : навч. посіб. Одеса, 2017. 200 с.
11. Лещинський О. Л., Школьний О. В. Економічний ризик та методи його вимірювання: навч. посіб. для студентів вищих навчальних закладів. Київ : Дельта, 2015. 112 с.
12. Мазаракі А.А. Управління ризиками в зовнішньоекономічній діяльності : підручник / А.А. Мазаракі, Т.М. Мельник, О.В. Генералов. Київ : Київ. нац. торг.-екон. ун-т, 2018. 312 с.
13. Машина Н. І. Економічний ризик і методи його вимірювання : навч. посіб. Київ : Центр навчальної літератури, 2018. 188 с.
14. Подсолонко Е.А. Менеджмент: теорія та практика : навч. посіб. Київ : ЦУЛ, 2015. 370 с.
15. Посохов І.М. Управління ризиками у підприємстві : навч. посіб. Харків : НТУ «ХП», 2015. 220 с.
16. 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.
17. Управління ризиками : навч. наочний посіб. для здобувачів спеціальності 073 «Менеджмент» / М. О. Кравченко, К. О. Бояринова, К. О. Копішинська. Київ : КПІ ім. Ігоря Сікорського, 2021. 432 с. URL: <https://ela.kpi.ua/handle/123456789/43528>
 18. Amitabh Bhargava. Credit Risk Management Systems In Banks. ICID. Feb 10, 2016.
 19. Michael Rees. Business Risk and Simulation Modelling in Practice: Using Excel, VBA and @RISK. 1st Edition. The Wiley Finance Series, 2021. 464 p.
 20. Norman Marks. World-Class Risk Management. CreateSpace Independent Publishing Platform, 2015. 234 p.
 21. Н. Felix Kloman. Integrated Risk Assessment. Current Views of Risk Management. URL: <http://www.garp.com>.
 22. John K. Hollmann Project Risk Quantification. A Practitioner's Guide to Realistic Cost and Schedule Risk Management. Probabilistic Publishing, 2016. 416 p.

Інформаційні ресурси:

<http://www.rada.gov.ua> – інформаційно-пошукова система законодавчих і нормативних документів України

<http://www.search.global.epnet.com> – електронний формат наукових журналів

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

<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 «29» серпня 2023 р.