



## Силабус курсу Моделі управління ризиком

Освітньо-професійна програма «Системний аналіз»  
Ступінь вищої освіти – магістр  
Спеціальність: 124 «Системний аналіз»

Рік навчання: I, Семестр: II

Кількість кредитів: 5 Мова викладання: українська

### Керівник курсу

III

к.е.н., доцент. Данилюк Ірина Вадимівна

Контактна інформація Irynadanylyuk9@gmail.com, +380679466599

### Опис дисципліни

У сучасних реаліях ринкового економічного середовища діяльність суб'єктів господарювання супроводжується різними видами ризиків. Для прийняття ефективних управлінських рішень на мікро- та макрорівнях суб'єкту господарювання слід не уникати їх, а навчитись керувати ними, використовуючи розроблені у сучасній вітчизняній та зарубіжній літературі методи управління та нейтралізації ризиків, що дозволить звести до мінімуму їх рівень і водночас отримати очікуваний рівень доходу. Тому від сучасного фахівця вимагається правильно оцінити всі можливі варіанти проведення кожної конкретної господарської операції, для чого необхідно оволодіти сучасною, що враховує ризик, методологією аналізу та прийняття раціональних рішень, стратегією і тактикою антикризового управління економічним об'єктом в реальних умовах.

### Структура курсу

Години (лек. / сем.)	Тема	Результати навчання	Завдання
2/1	Тема 1. Сутність та види ризиків	Знати поняття ризику, його ймовірнісний характер. Розрізняти ознаки класифікації та види економічних ризиків. Розмежовувати ризики за економічними наслідками.	Поточне опитування
4 /1	Тема 2. Організація управління ризиками	Знати сутність ризик-менеджменту. Застосовувати етапи управління ризиками на практиці	Поточне опитування Практичні завдання
4/1	Тема 3. Статистичні методи оцінювання ризиків	Знати загальні принципи оцінки та аналізу ризику, показники підприємницького ризику. Вміти застосовувати метод варіаційного аналізу ризику. Уміти використати ймовірнісний метод аналізу ризику на практиці.	Поточне опитування Практичні завдання
2/1	Тема 4. Експертні методи оцінювання ризиків	Знати базові характеристики експертних процедур, їх використання для розрахунку рівня ризику проекту. Застосовувати основні етапи здійснення експертизи на практиці. Розуміти правила визначення сумарних експертних оцінок.	Поточне опитування Практичні завдання

4/2	Тема 5. Теорія корисності та схильності до ризику	Розуміти корисність та відношення пріоритетності. Орієнтуватися у функціях корисності. Вміти визначати очікувану корисність та детермінований еквівалент.	Поточне опитування Практичні завдання
2/2	Тема 6. Оцінка ризику інвестиційних проєктів.	Знати що таке накопичення та дисконтування, фінансова рента. Вміти здійснити оцінку інвестиційних проєктів в умовах ризику. Використати часову структуру процентних ставок при виборі коефіцієнту з метою оцінки фінансових ризиків.	Поточне опитування Практичні завдання
4/2	Тема 7. Основні способи регулювання ризиків	Знати способи зменшення ризиків:страхування, резервування, лімітування та система вибору партнерів. Вміти застосувати інструменти оптимізації ризиків.	Поточне опитування Практичні завдання
2/1	Тема 8. Гіпотези та моделі сучасної портфельної теорії	Знати гіпотези портфельної теорії. Вміти використати моделі Тобіна та Марковіца для управління ризиком формування інвестиційного портфеля, модель Шарпа, методи оцінювання доцільності диверсифікації портфеля активів.	Поточне опитування Практичні завдання
2/1	Тема 9. Ризики в інвестиційній діяльності	Знати портфельні, стратегічні та венчурні інвестори. Застосовувати критерії оцінок інвестиційних проєктів та розуміти вплив на їх значення ризиковості проєкту.	Поточне опитування Практичні завдання
2/1	Тема 10. Прийняття рішень в умовах ризику	Знати теоретико-ігровий підхід до моделювання ризику. Вміти здійснити вибір оптимальної стратегії в умовах ризику. Здійснити постанову задачі прийняття ризикових рішень на основі визначення оцінки можливих вигащів та невдач	Поточне опитування Практичні завдання
4/1	Тема 11. Практика управління ризиком	Знати поняття управління ризиком. Уміти застосувати основні підходи до процесу управління ризиком. Здійснювати організаційні заходи щодо управління ризиком в сучасних умовах.	МР

### Література

1. Васильсва Т.А., Кривич Я.М., Леонов С.В. Економічний ризик: методи оцінки та управління :навч. посіб. Суми : ДВНЗ «УАБС НБУ», 2020. - 208 с.
2. Вітлінський В.В. Ризикологія в економіці та підприємстві: монографія // Вітлінський В.В.,Великоіванченко Г.І. – Київ: КНЕУ, 2020. – 480 с.
3. Артим-Дрогомирецька З. Б. Економічний ризик: Навчальний посібник. / З. Б . Артим-Дрогомирецька. - К.: Центр учбової літератури, 2013.- 316с.
4. Економіко-математичне моделювання: навчальний посібник. / За ред.. О.Т . Іващука. – Тернопіль:ТНЕУ: Економічна думка, 2020. – 704с.
5. Івченко І.Ю . Моделювання економічних ризиків і ризикових ситуацій. Навч. посібник / І.Ю .Івченко – К.: Центр учбової літератури, 2020. – 344с.
6. Шегда А.В. Ризики в підприємстві:оцінювання та управління. Навч. посібник / А.В.Шегда,М.В.Голованенко. – К.:Знання, 2018. –271 с.
7. Балджи М.Д. Економічний ризик та методи його вимірювання. Навчальний

посібник. – Харків:Промарт, 2022. – 300 с.

8. Кучеренко В.Р., Карпов В.А., Карпов А.В. Економічний ризик та методи його вимірювання: Навчальний посібник. – Одеса, 2021. – 200 с.

9. Старостіна А. О., Кравченко В. А. Ризик-менеджмент: теорія та практика: Навч. посіб. – К.: ІВЦ

—Видавництво «Політехніка», 2004. – 200 с.

10. Посохов І.М. Управління ризиками у підприємстві: навчальний посібник / І. М. Посохов. –Харків : НТУ «ХП», 2020. – 220 с.

11. Управління фінансовими ризиками : навч. посібник / Куцик П.О., Васильців Т.Г., Сороківський В.М., Стефаняк В.І., Сороківська М.В. – Львів : Растр-7, 2019. – 318 с.

12. Вітлінський В. В. Економічний ризик : ігрові моделі : Навч. посібник / В. В. Вітлінський, П. І.Верченко, А. В. Сігал, Я. С. Наконечний.– К. : КНЕУ, 2022.– 446 с.

13. Amitabh Bhargava. Credit Risk Management Systems In Banks. — ICID. Feb 10, 2016.

14. Beck U. Risk Society. Towards a New Moderning. London, 2002. 298 p.

## Політика оцінювання

- **Політика щодо дедлайнів та перескладання:** Роботи, які здаються із порушенням термінів без поважних причин, оцінюються на нижчу оцінку (-20 балів). Перескладання модулів відбувається із дозволу деканату за наявності поважних причин (наприклад, лікарняний).
- **Політика щодо академічної доброчесності:** Усі письмові роботи перевіряються на наявність плагіату і допускаються до захисту із коректними текстовими запозиченнями не більше 20%. Списування під час контрольних робіт та екзаменів заборонені (в т.ч. із використанням мобільних девайсів).
- **Політика щодо відвідування:** Відвідування занять є обов'язковим компонентом оцінювання, за яке нараховуються бали. За об'єктивних причин (наприклад, хвороба, міжнародне стажування) навчання може відбуватись в он-лайн формі за погодженням із керівником курсу.

## Оцінювання

Модуль 1		Модуль 2	Модуль 3	Модуль 4	Разом,
Поточне оцінювання, 20%	Модульний контроль, 20%	Тренінги, 5%	Самостійна робота, 15%	Іспит, 40%	100%
Визначається як середнє арифметичне оцінок, отриманих на практичних заняттях (кожен здобувач має отримати не менше 4 оцінок)	Підсумкова контрольна робота, яка охоплює всі теми	Визначається оцінка, отримана за виконання завдання під час тренінгу	Визначається оцінка, отримана за виконання завдання самостійної роботи	Теоретичні запитання (2 по 20 балів)-макс. 40 балів Практична задача-макс. 60 балів	

## Шкала оцінювання:

За шкалою ЗУНУ	За національною шкалою	За шкалою ECTS
90–100	відмінно	A (відмінно)
85–89	добре	B (дуже добре)

75-84		С (добре)
65-74	задовільно	D (задовільно)
60-64		E (достатньо)
35-59	незадовільно	FX (незадовільно з можливістю повторного складання)
1-34		F (незадовільно з обов'язковим повторним курсом)

