

**НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ БІОРЕСУРСІВ ТА
ПРИРОДОКОРИСТУВАННЯ УКРАЇНИ**

Кафедра економічної кібернетики

ЗАТВЕРДЖЕНО

Факультет інформаційних технологій
“12”червня 2025 р.

**РОБОЧА ПРОГРАМА
НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ**

Ризик-менеджмент

Галузь знань 05 Соціальні та поведінкові науки
спеціальність 051 «Економіка»
освітня програма Економічна кібернетика
Факультет Інформаційних технологій
Розробник: к.е.н., доцент кафедри економічної кібернетики Негрей М.В.

Київ – 2025 р.

Опис навчальної дисципліни

Дисципліна дає можливість набуття знань про якісні властивості та кількісні характеристики економічних процесів з урахуванням ризику – характерного чинника сучасної економіки; опанувати методологією та методикою побудови, аналізу та застосування економіко-математичних моделей, що враховують ризик; вивчити найбільш типові прийоми моделювання та вимірювання економічного ризику у процесі прийняття рішень, опанувати відповідним апаратом.

Галузь знань, спеціальність, освітня програма, освітній ступінь		
Освітній ступінь	Бакалавр	
Напрямок підготовки	Економічна кібернетика	
Спеціальність	051 Економіка	
Характеристика навчальної дисципліни		
Вид	базова	
Загальна кількість годин	150	
Кількість кредитів ECTS	5	
Кількість змістових модулів	2	
Курсовий проект (робота) (за наявності)		
Форма контролю	залік	
Показники навчальної дисципліни для денної форми навчання		
	денна форма навчання	заочна форма навчання
Рік підготовки (курс)	3	-
Семестр	5	-
Лекційні заняття	30год.	-
Практичні, семінарські заняття	30год.	-
Лабораторні заняття	-	-
Самостійна робота	90	-
Індивідуальні завдання		-
Кількість тижневих аудиторних годин для денної форми навчання	4 год.	-

Мета, компетентності та програмні результати навчальної дисципліни

Мета: оволодіння студентами теоретико-методологічними та практичними навичками здійснення ідентифікації, аналізу, вимірювання, моделювання систем управління економічними ризиками

Набуття компетентностей

загальні компетентності (ЗК):

ЗК11. Здатність приймати обґрунтовані рішення.

фахові (спеціальні) компетентності (СК):

СК9. Здатність прогнозувати на основі стандартних теоретичних та економетричних моделей соціально-економічні процеси.

СК11. Здатність обґрунтовувати економічні рішення на основі розуміння закономірностей економічних систем і процесів та із застосуванням сучасного методичного інструментарію.

СК14. Здатність поглиблено аналізувати проблеми і явища в одній або декількох професійних сферах з врахуванням економічних ризиків та можливих соціально-економічних наслідків.

СК16. Здатність аналізувати та моделювати оцінку економічного ризику для різних професійних сфер та видів економічної діяльності.

Програмні результати навчання:

ПР12. Застосовувати набуті теоретичні знання для розв'язання практичних завдань та змістовно інтерпретувати отримані результати.

ПР13. Ідентифікувати джерела та розуміти методологію визначення і методи отримання соціально-економічних даних, збирати та аналізувати необхідну інформацію, розраховувати економічні та соціальні показники.

ПР17. Виконувати міждисциплінарний аналіз соціально-економічних явищ і проблем в одній або декількох професійних сферах з врахуванням ризиків та можливих соціально-економічних наслідків.

ПР22. Демонструвати гнучкість та адаптивність у нових ситуаціях, у роботі із новими об'єктами, та у невизначених умовах.

2. Програма та структура навчальної дисципліни

Назви змістових модулів і тем	Кількість годин											
	денна форма						заочна форма					
	усь го	у тому числі					усь ог о	у тому числі				
		л	п	лаб	ін д	с.р.		л	п	ла б	ін д	с.р.
Змістовий модуль 1. Сутнісна характеристика та методи оцінки економічних ризиків												
Тема 1. Ризик як економічна категорія. Його сутність.	25	5		5		15						
Тема 2. Методи аналізу ризику.	25	5		5		15						
Тема 3. Система кількісних оцінок економічного ризику.	25	5		5		15						
Разом за змістовим модулем 1	75	15		15		45						
Змістовий модуль 2. Моделювання економічного ризику												
Тема 4. Основні засади теорії портфеля в умовах ризику та диверсифікація як спосіб зниження ризику.	25	5		5	-	15						
Тема 5. Теорія корисності та прийняття рішень в умовах ризику	25	5		5	-	15						
Тема 6. Моделювання економічного ризику та теорії гри	25	5		5	-	15						
Разом за змістовим модулем 2	75	15		15	-	45						
Усього годин	150	30		30	-	90						

3. Темі лекцій

№ з/п	Назва теми	Кількість годин
1	Тема 1. Ризик як економічна категорія. Його сутність.	4
2	Тема 2. Методи аналізу ризику.	6
3	Тема 3. Система кількісних оцінок економічного ризику.	6
4	Тема 4. Основні засади теорії портфеля в умовах ризику та диверсифікація як спосіб зниження ризику.	4
5	Тема 5. Теорія корисності та прийняття рішень в умовах ризику	4
6	Тема 6. Моделювання економічного ризику та теорії гри	6
Разом		30

4. Темі практичних занять

№ з/п	Назва теми	Кількість годин
1.	Основи теорії ймовірності та оцінка ризиків	2
2.	Закони розподілу випадкових величин	2
3.	Методи критичних значень та сценарного аналізу ризику	2
4.	Методи аналізу банкрутства суб'єктів господарювання	4

5.	Система кількісних оцінок економічного ризику	2
6.	Система кількісних оцінок фінансового ризику	4
7.	Основні засади теорії портфеля в умовах ризику та диверсифікації	2
8.	Практичні особливості реалізації теорії портфеля	4
9.	Теорія корисності та прийняття рішень в умовах ризику	2
10.	Теорія корисності та прийняття інвестиційних рішень	2
11.	Критерії Байєса, Бернуллі-Лапласа та модальний критерій для оцінки ризику	2
12.	Критерії Вальда, Гурвіца та Ходжеса-Лемана для оцінки ризику	2
	Разом	30

4.Самостійна робота

№ з/п	Назва теми	Кількість годин
1	Ризик як економічна категорія. Його сутність.	15
2	Методи аналізу ризику.	15
3	Система кількісних оцінок економічного ризику.	15
4	Основні засади теорії портфеля в умовах ризику та диверсифікація як спосіб зниження ризику.	15
5	Теорія корисності та прийняття рішень в умовах ризику	15
6	Моделювання економічного ризику та теорії гри	15
	Разом	90

6. Методи та засоби діагностики результатів навчання:

усне або письмове опитування;
співбесіда;
тестування;
розрахункові роботи;
захист практичних робіт;
самооцінювання.

7. Методи навчання:

метод проблемного навчання;
метод практико-орієнтованого навчання;
кейс-метод;
метод проєктного навчання;
метод перевернутого класу, змішаного навчання;
метод навчальних дискусій та дебат.

8. Оцінювання результатів навчання

Оцінювання знань здобувача вищої освіти відбувається за 100-бальною шкалою і переводиться в національну оцінку згідно чинного «Положення про екзамени та заліки у НУБіП України».

8.1. Розподіл балів за видами навчальної діяльності

Вид навчальної діяльності	Результати навчання	Оцінювання
Змістовий модуль 1. Сутнісна характеристика та методи оцінки економічних ризиків		
<i>Практична 1.</i> Основи теорії ймовірності та оцінка ризиків	ПР12,13,17,22. Застосовувати набуті теоретичні знання для розв'язання практичних завдань та змістовно інтерпретувати отримані результати. Ідентифікувати джерела та розуміти методологію визначення і методи отримання соціально-економічних даних, збирати та аналізувати необхідну інформацію, розраховувати економічні та соціальні показники. Виконувати міждисциплінарний аналіз соціально-економічних явищ і проблем в одній або декількох професійних сферах з врахуванням ризиків та можливих соціально-економічних наслідків. Демонструвати гнучкість та адаптивність у нових ситуаціях, у роботі із новими об'єктами, та у невизначених умовах.	10
<i>Практична 2.</i> Закони розподілу випадкових величин		10
<i>Практична 3.</i> Методи критичних значень та сценарного аналізу ризику		5
<i>Практична 4.</i> Методи аналізу банкрутства суб'єктів господарювання		5
<i>Практична 5.</i> Система кількісних оцінок економічного ризику		10
<i>Практична 6.</i> Система кількісних оцінок фінансового ризику		5
<i>Самостійна робота 1.</i> Ризик як економічна категорія. Його сутність.		10
<i>Самостійна робота 2.</i> Методи аналізу ризику.		10
<i>Самостійна робота 3.</i> Система кількісних оцінок економічного ризику.		5
Модульна контрольна робота 1		30
Всього за модулем 1		100
Модуль 2. Моделювання економічного ризику		
<i>Практична 7.</i> Основні засади теорії портфеля в умовах ризику та диверсифікації	ПР12,13,17,22. Застосовувати набуті теоретичні знання для розв'язання практичних завдань та змістовно інтерпретувати отримані результати. Ідентифікувати джерела та розуміти методологію визначення і методи отримання соціально-економічних даних, збирати та аналізувати необхідну інформацію, розраховувати економічні та соціальні показники. Виконувати міждисциплінарний аналіз соціально-економічних явищ і проблем в одній або декількох професійних сферах з врахуванням ризиків та можливих соціально-економічних наслідків. Демонструвати гнучкість та адаптивність у нових ситуаціях, у роботі із новими об'єктами, та у невизначених умовах.	5
<i>Практична 8.</i> Практичні особливості реалізації теорії портфеля		10
<i>Практична 9.</i> Теорія корисності та прийняття рішень в умовах ризику		10
<i>Практична 10.</i> Теорія корисності та прийняття інвестиційних рішень		10
<i>Практична 11.</i> Критерії Байєса, Бернуллі-Лапласа та модальний критерій для оцінки ризику		10
<i>Практична 12.</i> Критерії Вальда, Гурвіца та Ходжеса-		10

Вид навчальної діяльності	Результати навчання	Оцінювання
Лемана для оцінки ризику		
Самостійна робота 4. Основні засади теорії портфеля в умовах ризику та диверсифікація як спосіб зниження ризику.		5
Самостійна робота 5. Теорія корисності та прийняття рішень в умовах ризику		5
Самостійна робота 6. Моделювання економічного ризику та теорії гри		5
Модульна контрольна робота 2		30
Навчальна робота	$0,7 \cdot (M1 + M2) \leq 70$	
Екзамен	30	
Всього за курс	$(\text{Навчальна робота} + \text{екзамен}) \leq 100$	

8.2. Шкала оцінювання знань здобувача вищої освіти

Рейтинг здобувача вищої освіти, бали	Оцінка за національною системою (екзамени/заліки)
90-100	відмінно
74-89	добре
60-73	задовільно
0-59	незадовільно

8.3. Політика оцінювання

Політика щодо дедлайнів та перескладання	Роботи, які здаються із порушенням термінів без поважних причин, оцінюються на нижчу оцінку. Перескладання модулів відбувається із дозволу лектора за наявності поважних причин (наприклад, лікарняний)
Політика щодо академічної доброчесності	Списування під час контрольних робіт та екзаменів заборонені (в т.ч. із використанням мобільних девайсів). Реферати повинні мати коректні текстові посилання на використану літературу
Політика щодо відвідування	Відвідування занять є обов'язковим. За об'єктивних причин (наприклад, хвороба, міжнародне стажування) навчання може відбуватись індивідуально (в он-лайн формі за погодженням із деканом факультету)

9. Навчально - методичне забезпечення

1. Електронний навчальний курс, розроблений на базі платформи LMS Moodle, розміщений на навчальному порталі НУБіП України за адресою: URL : <https://elearn.nubip.edu.ua/course/view.php?id=291>

2. Негрей М.В. Методичні вказівки до виконання лабораторних робіт з дисципліни «Ризикологія» для студентів ОС «Бакалавр», галузі знань 05 «Соціальні та поведінкові науки», спеціальності 051 – Економіка, ОПП «Цифрова економіка» та «Економічна кібернетика» Київ: НУБіП, 2022. 153с.

3. Негрей М.В. Економічний ризик: навч.-метод. посібник із грифом

МОНмолодьспорт України / З. Б. Артим-Дрогомирецька, М. В. Негрей / Львів: Магнолія. 2006, 2013. 320 с.

4. Скрипник А.В. Негрей М.В. Економетричні моделі економіки: навчальний посібник / А.В. Скрипник, М.В. Негрей. Київ: Компринт, 2015. 232 с.

10. Рекомендовані джерела інформації

1. Жерліцин Д.М. Моделі ризик-менеджменту : методичні вказівки до виконання курсових робіт [для студентів ОПП «Економічна кібернетика» спеціальності 051 «Економіка»]. Київ: НУБіП, 2020. 104 с.

2. Скрипник А.В., Галаєва Л.В., Кравченко К.Я. «Вища та прикладна математика» Розділ «Теорія ймовірностей та математична статистика» Методичний посібник. К: «Аграр Медіа Груп». 2012. 144 с. URL: <http://elibrary.nubip.edu.ua/16947/>

3. Скрипник А.В. Ризикологія. Розділ 1. Кількісні оцінки ризику. Методичні розробки. К.: ТОВ «Аграр Медіа Груп», 2012. 110 с. URL: <http://elibrary.nubm.edu.ua/16945/>

4. Скрипник А.В., Галаєва Л.В., Долінська Є.Б. Математичні моделі та планування експерименту: Методичні розробки К.: ТОВ «Аграр Медіа Груп», 2011. 130 с.

5. Скрипник А.В. Економічний ризик та ризик в оподаткуванні. - Ірпінь: Національна академія ДПС України, 2007. 112с.

6. Бережнюк І. Г. Ризикологія в митній сфері /Зовнішньоекономічна політика держави та актуальні проблеми митної справи: економіко-управлінські, правові, інформаційно-технічні, гуманітарні аспекти [Текст]: матеріали міжнародної науково-практичної конференції. Дніпропетровськ: Академія митної служби України, 2012. С. 45–47.

7. Боярко І. М. Інвестиційний аналіз: Навч. посіб. К.: Центр учбової літератури, 2011. 400 с.

8. Вітлінський В. В., Великоіваненко Г. І. Ризикологія в економіці та підприємстві: Монографія. К.: КНЕУ, 2004. 480 с.

9. Еш С.М. Фінансовий ринок: Навч. Посібник. К.: Центр учбової літератури, 2009. 528 с.

10. Жерліцин Д.М. Інноваційне управління фінансовою системою підприємства : монографія Донецьк: ТОВ «Юго-Восток, Лтд», 2012. 256 с.

11. Модернізація фінансових систем: методологія та інструменти управління / Ю.Г. Лисенко; Н.С. Педченко; В.М. Кравченко; В.В. Мандра; М.О. Мизнікова; В.М. Берлін; В.М. Лев та ін. / За ред. чл.кор. НАН України, д-ра екон. наук, проф. Лисенко Ю.Г.; д-ра екон. наук, доц. Жерліцина Д.М. Полтава, 2017. 348 с.

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

13. Піскун Р.В. Управління фінансовими ризиками : навч. посіб. К.: Знання, 2010. 598 с.
14. Ризик - менеджмент у сфері фінансових послуг : конспект лекцій / укладачі : В. М. Олійник, С. М. Фролов, І. М. Кобушко. Суми : Сумський державний університет, 2014. 134 с.
15. Куцик П. О., Васильців Т. Г., Сороківський В. М., Стефаняк В. І., Сороківська М. В. Управління фінансовими ризиками : навч. посібник. Львів : Растр-7, 2016. 318 с.
16. 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.
17. Giddens A. Modernity and Self-Identity: Self and Society in the Late Modern Age. Stanford, 1991.
18. Principles of Valuation: Time Value of Money by Gautam Kaul, Qin Lei. –Access at: <https://class.coursera.org/timevalueofmoney-001/lecture>