

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ

Одеський національний технологічний університет

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Ризикологія

Назва дисципліни

Вибіркова

навчальна дисципліна

Обов'язкова/Вибіркова

Мова навчання – українська

українська/англійська

Освітньо-професійна програма

міжнародна торгівля зерном

(назва ОП)

Код та найменування спеціальності 076 Підприємництво, торгівля та біржова діяльність

(код та найменування спеціальності)

Шифр та найменування галузі знань 07 Управління та адміністрування

(шифр та найменування галузі знань)

Ступінь вищої освіти бакалавр

бакалавр/магістр

Розглянуто, схвалено та затверджено
Методичною радою університету

РОЗРОБЛЕНО ТА ЗАБЕЗПЕЧУЄТЬСЯ: кафедрою управління бізнесом Одеського національного технологічного університету

РОЗРОБНИК (розробники): Володимир ШАЛЕНИЙ, доцент кафедри управління бізнесом, кандидат економічних наук
(вказати авторів, їхні посади, наукові ступені та вчені звання)

Розглянуто та схвалено на засіданні кафедри управління бізнесом
Протокол від «7» ____ 09 ____ 2022 р. № 3

Завідувач кафедри ПІДПИСАНО Наталія БАСЮРКІНА
(підпис) Ім'я, ПРІЗВИЩЕ

Розглянуто та схвалено методичною радою зі спеціальності 076 Підприємництво, торгівля та біржова діяльність галузі знань 07 Управління та адміністрування

Голова ради ПІДПИСАНО Марина МАРДАР
(підпис) Ім'я, ПРІЗВИЩЕ

Гарант освітньої програми ПІДПИСАНО Юлія БРОВКІНА
(підпис) Ім'я, ПРІЗВИЩЕ

Розглянуто та схвалено Методичною радою університету
Протокол від «__» _____ 20__ р. № ____

Секретар Методичної ради університету ПІДПИСАНО Валерій МУРАХОВСЬКИЙ
(підпис) Ім'я, ПРІЗВИЩЕ

ЗМІСТ

1	Пояснювальна записка.....	4 стор.
1.1	Мета та завдання навчальної дисципліни	4 стор.
1.2	Компетентності, які може отримати здобувач вищої освіти.....	4 стор.
1.3	Міждисциплінарні зв'язки.....	6 стор.
1.4	Обсяг навчальної дисципліни в кредитах ЄКТС.....	6 стор.
2	Зміст дисципліни:.....	7 стор.
2.1	Програма змістових модулів.....	7 стор.
2.2	Перелік практичних робіт.....	8 стор.
2.3	Перелік завдань до самостійної роботи.....	8 стор.
3	Критерії оцінювання результатів навчання.....	9 стор.
4	Інформаційне забезпечення.....	10 стор.

1. Пояснювальна записка

1.1. Мета та завдання навчальної дисципліни

Навчити майбутніх фахівців теорії економічних ризиків, методів їх вимірювання, прийомів зниження ступеня економічного ризику з урахуванням зовнішніх та внутрішніх чинників розвитку суб'єкта підприємництва, методів прогнозування кінцевого результату і вибору оптимальної стратегії діяльності в умовах невизначеності, випадковості та конфліктності.

В результаті вивчення курсу «Ризикологія» студенти повинні

знати:

- сутність економічних ризиків, ризик-менеджменту,
- методи кількісної та якісної оцінки економічних ризиків, побудови профілю ризику суб'єкта підприємництва;
- прикладний інструментарій управління ступенем економічного ризику суб'єкта підприємництва;
- методи оцінки ефективності заходів, спрямованих на оптимізацію та оптимізацію загального рівня економічного ризику суб'єкта підприємництва;
- вишукувати резерви підвищення ефективності діяльності суб'єктів підприємництва в умовах ризику;

вміти:

- ідентифікувати ризики суб'єкта підприємництва;
- розраховувати показники, які характеризують міру та ступінь економічного ризику, а також величину можливих збитків;
- аналізувати отримані результати вивчення ризикованих ситуацій;
- обґрунтовувати доцільність використання в конкретній ситуації того чи іншого прийому зниження ступеня економічного ризику.

1.2. Компетентності, які може отримати здобувач вищої освіти

У результаті вивчення навчальної дисципліни «Ризикологія» здобувач вищої освіти отримує наступні програмні компетентності та програмні результати навчання, які визначені в [Стандарті вищої освіти зі спеціальності 076 Підприємництво, торгівля та біржова діяльність](#) та [освітньо-професійної програми «Міжнародна торгівля зерном»](#) підготовки бакалаврів.

Загальні компетентності:

- ЗК1.** Здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу.
- ЗК2.** Здатність застосовувати отримані знання в практичних ситуаціях, виявляти, ставити та вирішувати завдання у сфері професійної діяльності.
- ЗК4.** Навички використання інформаційних і комунікаційних технологій.
- ЗК5.** Здатність до пошуку, оброблення та аналізу інформації з різних джерел.
- ЗК9.** Здатність діяти відповідально та свідомо.

Спеціальні (фахові, предметні) компетентності:

СК2. Здатність обирати та використовувати відповідні методи, інструментарій для обґрунтування рішень щодо створення, функціонування підприємницьких, торговельних і біржових структур.

СК3. Розуміння форм взаємодії суб'єктів ринкових відносин.

СК5. Здатність визначати та оцінювати характеристики товарів і послуг в підприємницькій, торговельній, біржовій діяльності.

СК6. Знання і розуміння нормативно-правового регулювання у сфері підприємницької, торговельної та біржової діяльності.

СК8. Знання і розуміння основ обліку та оподаткування в підприємницькій, торговельній, біржовій діяльності.

СК9. Знання та розуміння організації зовнішньоекономічної діяльності підприємницьких, торговельних і біржових структур.

СК10. Здатність до бізнес-планування, оцінювання кон'юнктури ринків і результатів діяльності у сфері підприємництва, торгівлі та біржової практики з урахуванням ризиків.

Програмні результати навчання:

ПРН1. Використовувати базові знання з підприємництва, торгівлі і біржової діяльності й уміння критичного мислення, аналізу та синтезу в професійних цілях.

ПРН2. Застосовувати набуті знання для виявлення, постановки та вирішення завдань за різних практичних ситуацій в підприємницькій, торговельній та біржовій діяльності.

ПРН4. Використовувати сучасні комп'ютерні і телекомунікаційні технології обміну та розповсюдження професійно спрямованої інформації у сфері підприємництва, торгівлі та біржової діяльності.

ПРН5. Організувати пошук, самостійний відбір, якісну обробку інформації з різних джерел для формування банків даних у сфері підприємництва, торгівлі та біржової діяльності.

ПРН7. Проявляти ініціативу і підприємливість в різних напрямках професійної діяльності, брати відповідальність за результати.

ПРН10. Володіти методами та інструментарієм для обґрунтування управлінських рішень щодо створення й функціонування підприємницьких, торговельних і біржових структур.

ПРН11. Використовувати знання форм взаємодії суб'єктів ринкових відносин для забезпечення діяльності підприємницьких, торговельних та біржових структур.

ПРН13. Оцінювати характеристики товарів і послуг у підприємницькій, торговельній та біржовій діяльності за допомогою сучасних методів.

ПРН14. Знати основи нормативно-правового забезпечення діяльності підприємницьких, торговельних та біржових структур і застосовувати на практиці.

ПРН15. Вміти вирішувати професійні завдання з організації діяльності підприємницьких, торговельних та біржових структур і розв'язувати проблеми у кризових ситуаціях з урахуванням зовнішніх та внутрішніх впливів.

ПРН16. Використовувати знання основ обліку та оподаткування в

підприємницькій, торговельній і біржовій діяльності.

ПРН17. Застосовувати знання й уміння щодо ефективної організації зовнішньоекономічної діяльності підприємницьких, торговельних та біржових структур з урахуванням ринкової кон'юнктури і діючих правових норм.

ПРН18. Демонструвати вміння бізнес-планування, оцінювання кон'юнктури ринків та результатів діяльності підприємницьких, торговельних і біржових структур з урахуванням ризиків.

1.3. Міждисциплінарні зв'язки

Попередні – основи підприємництва, економіка підприємства, управління бізнесом, діагностика внутрішнього стану підприємства, послідовні – діагностика проектів, зовнішньоекономічна діяльність, інвестиційний менеджмент.

1.4. Обсяг навчальної дисципліни в кредитах ЄКТС

Навчальна дисципліна викладається на 3 курсі у 6 семестрі для денної форми навчання та на 4 курсі у 7 семестрі для заочної форми навчання.

Кількість кредитів ECTS - 3, годин – 90 для денної форми навчання;

Кількість кредитів ECTS - 6, годин – 180 для заочної форми навчання.

Аудиторні заняття, годин:	всього	лекції	практичні
денна	42	20	22
заочна	14	8	6
Самостійна робота, годин	Денна - 48		Заочна - 166

2. Зміст дисципліни

2.1. Програма змістовних модулів

Змістовний модуль 1: Теоретичні основи ризикології

№ теми	Зміст теми	Годин	
		Денна	Заочна
1.	Сутнісна характеристика економічних ризиків і джерел їх виникнення. Сутність сучасної ризикології, поняття та джерела ризику. Предмет, об'єкт та суб'єкт ризикології. Аксиоматика ризикології. Функції ризику. Класифікація ризиків.	2	0,5
2.	Класифікація ризиків. Чисті та спекулятивні ризики. Інвестиційні та фінансові ризики. Ризики виробничих систем. Інші класифікаційні ознаки ризиків.	2	0,5
3.	Концептуальні засади управління ризиками. Стратегія та тактика управління ризиками. Ризик-менеджмент. Стандартизація управління ризиками. Етапи управління ризиками.	2	0,5
4.	Механізми та інструменти управління ризиками. Самофінансування ризиків. Трансферт ризиків. Мінімізація втрат та попередження збитків. Диверсифікація. Хеджування. Страхування ризиків.	2	0,5
Всього		8	2

Змістовний модуль 2: Методичні засади оцінки ризиків

№ теми	Зміст теми	Годин	
		Денна	Заочна
1.	Класифікація методів оцінки ризиків. Оцінка ризиків в умовах часткової невизначеності. Оцінка ризиків в умовах повної невизначеності. Розрахунково-аналітичні методи оцінки ризиків	2	1
2.	Сценарійні методи оцінки ризиків. Метод «дерева рішень». Теорія ігор при оцінці ризиків. Аналіз сценаріїв. Структурований аналіз сценаріїв методом «що? якщо?» (метод SWIFT), Метод «Краватка-метелик». Діаграма Ісікаві.	2	1
3.	Імітаційне моделювання при оцінці ризиків. Особливості застосування методу Монте-Карло. Етапи методу Монте-Карло. Програмні продукти для генерації випадкових сценаріїв. Інтерпретація результатів імітаційного моделювання та показники рівня ризику.	2	1
Всього		6	3

Змістовний модуль 3: Управління окремими ризиками.

№ теми	Зміст теми	Годин	
		Денна	Заочна
1.	Управління транспортними ризиками та ризиками виробничих систем. Поняття транспортних ризиків. Застосування правил Інкотермс (2010) для оцінки транспортних ризиків. Особливості механізму управління транспортними ризиками. Поняття ризиків виробничих систем. Постачальницькі, виробничі та збутові ризики. Особливості оцінки та механізму управління ризиками виробничих систем.	2	1

2.	Фінансові ризики. Поняття фінансових ризиків. Види фінансових ризиків. Особливості оцінки та механізму управління фінансовими ризиками.	2	1
3.	Інвестиційні та проектні ризики. Поняття інвестиційних та проектних ризиків. Особливості оцінки і механізму управління інвестиційними та проектними ризиками.	2	1
Всього		6	3

2.2. Перелік практичних робіт

№ практ. роб.	Назва практичної роботи	Годин	
		Денна	Заочна
1	Класифікація ризиків підприємства (ідентифікація ризиків підприємства та їх якісний аналіз методом «мозкового штурму», ранжування та рейтингування ризиків підприємства, оцінка узгодженості думок експертів за допомогою показників коефіцієнта конкордації та тесту рангової кореляції Спірмена)	2	1
2	Статистичний метод оцінки ризиків (статистичні показники оцінки ризику, оцінка міри та ступеня ризику, використання статистичних показників оцінки ризиків при виборі альтернативних інвестиційних проектів)	4	1
3	Оцінка ризиків та теорія ігор (оцінки ризиків за допомогою критеріїв теорії ігор (критерії Байеса, Лапласа, Вальда, Севіджа та Гурвіца, використання критеріїв при виборі альтернативних інвестиційних проектів)	4	1
4	Прийняття рішень в умовах ризиків за допомогою методу «дерева рішень» (Структуризація та декомпозиція проблеми прийняття рішення в умовах ризику, розрахунок EMV, вибір варіанту управлінського рішення)	4	1
5	Метод аналізу чутливості при аналізі проектних ризиків (вибір узагальнюючого показника ефективності проекту та ризик-змінних, розрахунок коефіцієнтів еластичності, розробка заходів по зниженню проектних ризиків)	4	1
6	Метод Монте-Карло при аналізі проектних ризиків (структуризація моделі, підбір законів розподілу випадкових величин, прогони моделі, графічна та аналітична інтерпретація результатів моделювання, вибір управлінського рішення)	4	1
Всього		22	6

2.3. Перелік завдань до самостійної роботи

№ з/п	Назва теми	Кількість годин	
		денна форма навчання	заочна форма навчання
1	Опрацювання лекційного матеріалу	10	20
	Тема 1. Сутнісна характеристика економічних ризиків і джерел їх виникнення	0,5	1
	Тема 2. Класифікація ризиків	0,5	1

	Тема 3. Концептуальні засади управління ризиками	0,5	1
	Тема 4. Механізми та інструменти управління ризиками	1	2
	Тема 5. Класифікація методів оцінки ризиків	0,5	1
	Тема 6. Сценарійні методи оцінки ризиків	1	2
	Тема 7. Імітаційне моделювання при оцінці ризиків	1	2
	Тема 8. Інші методи оцінки ризиків	1	2
	Тема 9. Управління ризиками виробничих систем	1	2
	Тема 10. Управління транспортними ризиками	1	2
	Тема 11. Фінансові ризики	1	2
	Тема 12. Інвестиційні та проектні ризики	1	2
2	Підготовка до практичних занять	10	20
	Тема 1. Класифікація ризиків підприємства	2	4
	Тема 2. Статистичний метод оцінки ризиків	2	4
	Тема 3. Оцінка ризиків та теорія ігор	2	4
	Тема 4. Прийняття рішень в умовах ризиків за допомогою методу «дерева рішень»	2	4
	Тема 5. Метод аналізу чутливості при аналізі проектних ризиків	2	4
3	Опрацювання окремих розділів програми, які не виносяться на лекції	10	20
	Тема 12. Інвестиційні та проектні ризики	10	20
4	Виконання індивідуальних завдань	16	16
	Всього	46	76

3. Критерії оцінювання результатів навчання

Види контролю: поточний, підсумковий – диф. залік
диф. залік/екзамен

Нарахування балів за виконання змістовного модуля

Вид роботи, що підлягає контролю	Оцінні бали		Форма навчання					
			денна			заочна		
	min	max	Кіль-ть робіт	Сумарні бали		Кіль-ть робіт	Сумарні бали	
				min	max		min	max
1	2	3	4	5	6	7	8	9
Змістовий модуль 1. Теоретичні основи ризикології								
Виконання практичних робіт	5	10	1	5	10	1	5	10
Опрацювання тем, не винесених на лекції	1	2	5	5	10	5	5	10

Підготовка до практичних робіт	2	4	1	2	4	1	2	4
Виконання індивідуальних завдань	10	20	1	10	20	1	10	20
Проміжна сума				22	44		22	44
Модульний контроль (тестовий)	38	56		38	56		38	56
Оцінка за змістовий модуль 1				60	100		60	100
Змістовний модуль 2: Методичні засади оцінки ризиків								
Виконання практичних робіт	2/4	4/6	5	10	20	5	20	30
Опрацювання тем, не винесених на лекції	1/2	2/4	3	3	6	3	6	12
Підготовка до практичних робіт	1	2	5	5	10	5	5	10
Виконання індивідуальних завдань	10/15	20/20	1	10	20	1	15	20
Проміжна сума				28	56		46	72
Модульний контроль (тестовий)	32/14	44/28		32	44		14	28
Оцінка за змістовий модуль 2				60	100		60	100
Змістовний модуль 3: Управління окремими ризиками								
Опрацювання тем, не винесених на лекції	2/5	5/10	3	6	15	3	15	30
Виконання індивідуальних завдань	24/15	35/20	1	24	35	1	15	20
Проміжна сума				30	50		30	50
Модульний контроль (тестовий)	30	50		30	50		30	50
Оцінка за змістовий модуль 3				60	100		60	100

4. Інформаційні ресурси

1. Risk in the food economy – theory and practice [Текст] = [Ризик в харчовій економіці - теорія та практика] : monograph / Editors: J. Goral , M. Wigier ; Institute of Agricultural and Food Economics. — Warszawa, 2017. — 270 p. : tables, figure.

<https://elc.library.ontu.edu.ua/library-w/DocumentDescription?docid=OdONAHТ-cnv.BibRecord.161180>

2. Методи сучасної теорії управління [Текст] : підручник / А. П. Ладанюк, Н. М. Луцька, В. Д. Кишенько та ін. ; Нац. ун-т харч. технологій. — Київ : Ліра-К, 2019. — 368 с.

<https://elc.library.ontu.edu.ua/library-w/DocumentDescription?docid=OdONAHТ-cnv.BibRecord.164543>

3. Науково-методичні засади оцінки бізнесу в умовах Євроінтеграції [Текст] : монографія / В. В. Немченко, О. П. Антонюк, П. О. Антонюк та ін. ; за ред. В. В. Немченка ; Одес. нац. акад. харч. технологій. — Харків : Вид-во Іванченка І. С., 2019. — 214 с. : табл., рис. — Бібліогр.: с. 200-213.

<https://elc.library.ontu.edu.ua/library-w/DocumentDescription?docid=OdONAHТ.1284098>

4. Проектний аналіз [Електронний ресурс] : навч. посіб. / Н. Й. Басюркіна, С. А. Горбаченко, В. А. Карпов, Р. І. Шевченко-Перепьолкіна ; за ред. В. А. Карпова ; Одес. нац. екон. ун-т. — Київ, 2019. — Електрон. текст. дані: 320 с. — Бібліогр.: с. 314-319.

<https://elc.library.ontu.edu.ua/library-w/DocumentDescription?docid=OdONAHТ.1751534>

5. Basiurkina, N. Features of risk assessment of industrial enterprises activities [Текст] / N. Basiurkina, V. Shaleny // Економіка харчової промисловості : наук. журн. — 2018. — Т. 10, № 1. — С. 46-53

<https://elc.library.ontu.edu.ua/library-w/DocumentDescription?docid=OdONAHТ-cnv.BibRecord.162665>

6. Веріга, Г. В. Стрес - тестування як інструмент оцінки валютних ризиків підприємства [Текст] / Г. В. Веріга // Економіка. Фінанси. Право. — Київ : АФ"Аналітика", 2013. — № 7. — С. 6-9 ;23.

<https://elc.library.ontu.edu.ua/library-w/DocumentDescription?docid=OdONAHТ-cnv.BibRecord.110687>

7. Джемелінська, Л. В. Ризик - менеджмент в інноваційній діяльності молокопереробних підприємств України [Текст] / Л. В. Джемелінська // Економіка. Фінанси. Право. — Київ : АФ"Аналітика", 2013. — № 3. — С.14-16.

<https://elc.library.ontu.edu.ua/library-w/DocumentDescription?docid=OdONAHТ-cnv.BibRecord.120304>

8. Карпенко, О. С. Необхідність розробки і впровадження методик управління ризиками на промислових підприємствах України [Текст] / О. С. Карпенко ; наук. кер. *Басюркіна Н.Й. // Інновац. економіка. — 2012. — № 5 (31). — С. 49-51

<https://elc.library.ontu.edu.ua/library-w/DocumentDescription?docid=OdONAHТ-cnv.BibRecord.91909>

9. Лясковський, О. В. Управління економічними ризиками на харчовому підприємстві [Текст] / О. В. Лясковський, Є. П. Шутов // Економіка харчової промисловості : наук. журн. — 2012. — № 1 (13). — С.28-31

<https://elc.library.ontu.edu.ua/library-w/DocumentDescription?docid=OdONAHT-cnв.BibRecord.77744>

10. Шалений, В.А. Управління ризиками операційної діяльності хлібопекарських підприємств [Текст] : дис. ... канд. екон. наук : спец. 08.00.04 "Економіка та управління підприємствами (за видами економічної діяльності)" / В. А. Шалений ; наук. кер. Н. Й. Басюркіна ; Причорномор. наук.-дослід. ін-т економіки та інновацій, Одес. нац. акад. харч. технологій. — Одеса : ОНАХТ, 2019. — 281 с.

<https://elc.library.onaft.edu.ua/library-w/DocumentDescription?docid=OdONAHT-cnв.BibRecord.165297>