

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ

Одеська національна академія харчових технологій

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Ризикологія

Вибіркова навчальна дисципліна

Мова навчання - українська

Освітньо-професійна програма Економіка підприємства

Код та найменування спеціальності 051 Економіка

Шифр та найменування галузі знань 05 Соціальні та поведінкові науки

Ступінь вищої освіти бакалавр

Розглянуто, схвалено та затверджено
Методичною радою академії

РОЗРОБЛЕНО ТА ЗАБЕЗПЕЧУЄТЬСЯ: кафедрою управління бізнесом Одеської національної академії харчових технологій

РОЗРОБНИК (розробники): Шалений В.А., 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 «__» _____ 20__ р. №__

Завідувач кафедри _____ Басюркіна Н.Й.
(підпис) (прізвище та ініціали)

Розглянуто та схвалено методичною радою зі спеціальності 051 Економіка
(код та найменування спеціальності)

Голова ради _____ Купріна Н.М.
(підпис) (прізвище та ініціали)

Гарант освітньої програми _____ Кулаковська Т.А.
(підпис) (прізвище та ініціали)

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

Секретар Методичної ради академії _____ Мураховський В.Г.
(підпис) (прізвище та ініціали)

3
ЗМІСТ

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

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 051 Економіка](#) та [освітньо-професійній програмі «Економіка підприємства»](#) підготовки бакалаврів.

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

Кількість кредитів ECTS- 3, годин - 90

Аудиторні заняття, годин:	всього	лекції	практичні	лабораторні
денна	44	24	10	10
заочна	14	8	6	-
Самостійна робота, годин	Денна - 46		Заочна - 76	

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
4.	Інші методи оцінки ризиків. Статистичний метод оцінки ризиків. Аналіз чутливості. Метод аналогій. Точка беззбитковості. Система аналізу загроз, небезпечних чинників та контролю критичних точок (НАССР). Експертні методи оцінки ризиків.	2	1
Всього		8	4

Змістовний модуль 3: Управління окремими ризиками.

№ теми	Зміст теми	Годин	
		Денна	Заочна
1.	Управління ризиками виробничих систем. Поняття ризиків виробничих систем. Постачальницькі, виробничі та збутові ризики.. Особливості оцінки та механізму управління ризиками виробничих систем.	2	0,5

2.	Управління транспортними ризиками. Поняття транспортних ризиків. Застосування правил Інкотермс (2010) для оцінки транспортних ризиків. Особливості механізму управління транспортними ризиками.	2	0,5
3.	Фінансові ризики. Поняття фінансових ризиків. Види фінансових ризиків. Особливості оцінки та механізму управління фінансовими ризиками.	2	0,5
4.	Інвестиційні та проектні ризики. Поняття інвестиційних та проектних ризиків. Особливості оцінки і механізму управління інвестиційними та проектними ризиками.	2	0,5
Всього		8	2

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)	2	2
3	Оцінка ризиків та теорія ігор (оцінки ризиків за допомогою критеріїв теорії ігор (критерії Байеса, Лапласа, Вальда, Севіджа та Гурвіці, використання критеріїв при виборі альтернативних інвестиційних проектів)	2	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)	2	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)	2	1
Всього		10	6

2.3 Перелік лабораторних робіт

№ лабор. роб.	Назва лабораторної роботи	Годин	
		Денна	Заочна
1	Оцінка ризиків операційної діяльності (розрахунок точки беззбитковості, запасу міцності, операційного левереджу, інтерпретація результатів)	2	-
2	Використання R-аналізу для оцінки ризиків (розрахунок показників ліквідності, платоспроможності, фінансової стійкості, ділової активності та рентабельності, оцінка профілю ризику підприємства)	4	-

3	Оцінка ризиків методом Монте-Карло (постановка завдання та введення даних в Excel, генерація випадкових сценаріїв (прогон моделі), графічний аналіз отриманих результатів, розрахунок та аналіз показників рівня ризику (VAR, cVAR, статистичні показники оцінки міри та ступеня ризику)	4	-
Всього		10	-

2.4 Перелік завдань до самостійної роботи

№ з/п	Види навчальної діяльності	Кількість годин	
		денна форма навчання	заочна форма навчання
1	Опрацювання лекційного матеріалу	10	20
2	Підготовка до практичних занять	10	20
3	Опрацювання окремих розділів програми, які не виносяться на лекції	10	20
4	Виконання індивідуальних завдань	16	16
Всього		46	76

3 Критерії оцінювання результатів навчання 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	5/6	4	8	20	4	16	24
Виконання лабораторних робіт	2	5	3	6	15	-	-	-

Опрацювання тем, не винесених на лекції	1/2	2/4	3	3	6	3	6	12
Підготовка до практичних робіт	1	3	4	4	12	4	4	12
Виконання індивідуальних завдань	10/15	15/20	1	5	15	1	15	20
Проміжна сума				41	68		41	68
Модульний контроль (тестовий)	19	32		19	32		19	32
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. Управління підприємницьким ризиком / за заг. ред. Д. А. Штефанича; Тернопіл. акад. нар. госп-ва. — Тернопіль : Екон. думка, 1999. — 224 с.](#)
- [2. Вітлінський, В.В. Ризик у менеджменті / В. В. Вітлінський, С. І. Наконечний. — Київ : Борисфен-М, 1996. — 336 с.](#)
- [3. Вітлінський, В. В. Кількісне оцінювання ризику у фінансово-економічній сфері / В. В. Вітлінський, Г. І. Великоіваненко // Фінанси України. — 2003.-N11.-С.16-24.](#)
- [4. Внукова, Н. М. Базова методика оцінки економічного ризику підприємства / Н. М. Внукова, В. А. Смоляк // Фінанси України. — 2002.-N10.-С.15-21.](#)
- [5. Андрійчук, В.Г. Менеджмент. Прийняття рішень і ризик: навч. посіб. / В. Г. Андрійчук, Л. Бауер. — Київ : КНЕУ, 1998. — 316 с.](#)
- [6. Донець, Л.І. Економічні ризики та методи їх вимірювання : навч. посіб. / Л. І. Донець. — Київ : Центр навч. літ., 2006. — 312 с.](#)
- [7. Івченко, І.Ю. Моделювання економічних ризиків і ризикових ситуацій: навч. посіб. / І. Ю. Івченко. — Київ : ЦУЛ, 2007. — 344 с.](#)
- [8. Ілляшенко, С. М. Економічний ризик: навч. посіб. / С. М. Ілляшенко. — 2-ге, допов., перероб. — Київ : Центр навч. літ., 2004. — 220 с.](#)
- [9. Лук`янова, В.В. Економічний ризик: навч. посіб. / В. В. Лук`янова, Т. В. Головач. — Київ : Академвидав, 2007. — 464 с.](#)
- [10. Матвійчук, А.В. Аналіз і управління економічним ризиком: навч. посіб. / А. В. Матвійчук ; Вінниц. нац. техн. ун-т. — К : Центр навч. літ., 2005. — 224 с.](#)

11. Останкова, Л.А. Аналіз, моделювання та управління економічними ризиками: навч. посіб. / Л. А. Останкова, Н. Ю. Шевченко. — Київ : ЦУЛ, 2011. — 2011. — 256 с.
12. Старостіна, А.О. Ризик-менеджмент: теорія та практика: навч. посіб. / А. О. Старостіна, В. А. Кравченко ; Нац. техн. ун-т України "Київський політехнічний інститут". — Київ : Кондор; Політехніка НТУУ "КПІ", 2004. — 200 с.
13. Чорноморченко, Н.В. Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків : навч.-метод посіб. для самост. вивчення дисципліни / Н. В. Чорноморченко, І. С. Іванова, Н. С. Приймак. — Львів : Магнолія-2006, 2010. — 257 с.
14. Шегда, А.В. Ризики в підприємстві: оцінювання та управління: навч. посіб. / А. В. Шегда, М. В. Голованенко ; за ред А. В. Шегди. — Київ : Знання, 2008. — 271 с.
15. Шалений, В.А. Управління ризиками операційної діяльності хлібопекарських підприємств: 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.