

ПОЛТАВСЬКИЙ УНІВЕРСИТЕТ ЕКОНОМІКИ І ТОРГІВЛІ

Навчально-науковий інститут денної освіти
Кафедра економічної кібернетики бізнес економіки та інформаційних систем

ЗАТВЕРДЖУЮ
Завідувач кафедри

 Ж.А. Кононенко
«31» січня 2025 р.

РОБОЧА ПРОГРАМА навчальної дисципліни **«Ризикологія»**

освітня програма
спеціальність
галузь знань
ступінь вищої освіти

«Бізнес-економіка»
051 Економіка
05 Соціальні та поведінкові науки
бакалавр

Робоча програма навчальної дисципліни Ризикологія економіки схвалена та рекомендована до використання в освітньому процесі на засіданні кафедри економічної кібернетики, бізнес-економіки та інформаційних систем

Протокол від 31 січня 2025 року № 1

Полтава 2025

Укладач: Кононенко Ж.А., к.е.н., доцент, доцент кафедри економічної кібернетики, бізнес-економіки та інформаційних систем

ПОГОДЖЕНО:

Гарант освітньої програми

Спеціальності

Ступеня

«Бізнес економіка»

051 Економіка

бакалавр



Ж.А.КОНОНЕНКО

підпис

ініціали, прізвище

«31» січня 2025 року

Зміст

Розділ 1. Опис навчальної дисципліни.....	4
Розділ 2. Перелік коментентностей, які забезпечує дана навчальна дисципліна, програмні результати навчання.....	4
Розділ 3. Програма навчальної дисципліни.....	5
Розділ 4 Тематичний план навчальної дисципліни.....	6
Розділ 5. Система оцінювання знань студентів.....	9
Розділ 6. Інформаційні джерела.....	9
Розділ 7. Програмне забезпечення навчальної дисципліни	10

Розділ 1. Опис навчальної дисципліни

Таблиця 1 – Опис навчальної дисципліни «Ризикологія»

Місце у структурно-логічній схемі підготовки	<i>Пререквізити:</i> Економічна теорія, основи моделювання економіки, економетрика. <i>Постреквізити:</i> Логістика, Економічна безпека		
Мова викладання	Українська.		
Статус дисципліни – обов'язкова			
Курс/семестр вивчення		4 курс, 8 семестр	
Кількість кредитів ЄКТС/ кількість модулів		6	
Денна форма навчання:			
Кількість годин: – загальна кількість: 8 семестр – 120 годин			
- лекції: 16 год.			
- практичні заняття: 32 годин			
- самостійна робота: 72 годин			
- вид підсумкового контролю (ПМК, екзамен): екзамен			
Заочна форма навчання:			

Розділ 2. Перелік коментентностей, які забезпечує дана навчальна дисципліна, програмні результати навчання

Мета вивчення навчальної дисципліни є формування теоретичних знань та практичних навичок щодо аналізу, оцінювання, моделювання ризиків у реальному секторі економіки та набуття навичок практичного застосування інформаційних технологій для реалізації методів і моделей управління ризиком

Таблиця 2 – Перелік коментентностей, які забезпечує дана навчальна дисципліна, програмні результати навчання

Компетентності, якими повинен оволодіти здобувач	Програмні результати навчання
Здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу. Здатність приймати обґрунтовані рішення. Здатність пояснювати економічні та соціальні процеси і явища на основі теоретичних моделей, аналізувати і змістовно інтерпретувати отримані результати. Здатність застосовувати економіко-математичні методи та моделі для вирішення економічних задач. Здатність розробляти та обґрунтовувати заходи та проектні рішення з покращення результативності діяльності підприємства в умовах невизначеності та ризику	Застосовувати відповідні економіко-математичні методи та моделі для вирішення економічних задач. Впроваджувати в виробничу систему та систему управління підприємством розроблені заходи та проектні рішення з покращення результативності діяльності підприємства в умовах невизначеності та ризику; пропонувати стратегії його розвитку

Розділ 3. Програма навчальної дисципліни

Модуль 1. Основи ризик менеджменту

ТЕМА 1. Управління ризиком у діяльності економічних систем

Поняття ризику. Взаємозв'язок між ризиком та невизначеністю. Причини виникнення невизначеності та ієрархія її видів. Суб'єкти ризику. Класифікація суб'єктів ризику. Чинники ризику. Класифікація ризиків. Етапи управління ризиком. Ризикова ситуація. Типові ознаки ризикових ситуацій. Критерії оцінювання ризиків.

Ризик-менеджмент. Актуальність та зміст ризик-менеджменту. Загальний підхід до технології та моделювання процесу розробки управлінських рішень. Взаємодія методів і моделей при розробці управлінських рішень. Планування в управлінні ризиками. Організація системи ризик-менеджменту на підприємстві. Математичні основи ризик-менеджменту.

ТЕМА 2. Застосування теорії корисності в управлінні економічними ризиками

Основні визначення концепції корисності. Графік функції корисності. Пріоритети та їх числове вираження. Гранична корисність. Основні функції корисності.

Дерево рішень у контексті концепції корисності. Елементи дерева рішень. Етапи побудови дерева рішень.

Модуль 2. Методи оцінювання та управління ризиками реального сектору економіки

ТЕМА 3. Кількісні методи оцінювання ризику.

Ієрархія та пріоритети. Декомпозиція проблем в ієрархію. Види ієрархій. Метод аналізу ієрархій. Етапи методу аналізу ієрархій. Експертне оцінювання переваг та оцінка узгодженості висновків. Побудова матриць попарних порівнянь.

Моделювання ризикових ситуацій в умовах невизначеності. Методологія управління ризиками в умовах невизначеності. Критерії вибору ризикового варіанту в умовах невизначеності. Розрахунок локальних пріоритетів та їх синтез. Розрахунок нормалізованого вектора пріоритетів. Розрахунок узгодженості матриці.

ТЕМА 4. Використання дерева рішень в управлінні ризиком

Основні поняття. Сутність, застосування методу «дерево рішень». Етапи побудови. Використання дерева рішень в ризикології. Приклади.

ТЕМА 5. Моделювання ризикових ситуацій в умовах визначеності та невизначеності

Ієрархія. Види ієрархії. Метод аналізу Ієрархій. Експертне оцінювання переваг та оцінка узгодженості висновків. Повна невизначеність.

Інформаційна ситуація та критерії оцінювання. Критерії прийняття рішень. Приклади.

ТЕМА 6. Експертні методи оцінювання ризику.

Експертні методи оцінювання ризику: особливості, область використання і різновиди методу експертних оцінок. Обробка експертних оцінок. Проблема збіжності оцінок експертів, визначення збіжності оцінок. Методи прогнозування в задачах прийняття рішень (ЗПР). Принципи і класифікація методів прогнозування. Методи екстраполяції, неформальні методи, метод «Дельфи».

ТЕМА 7. Моделювання економічного ризику на основі концепції теорії ігор.

Теорія ігор. Концепції теорії гри. Критерій Парето. Активні чисті стратегії. Змішані стратегії. Інформаційна ситуація та критерії оцінювання. Критерій прийняття рішень.

Багатокритеріальні ігрові моделі. Сутність проблеми прийняття багатокритеріальних рішень. Нормалізація критеріїв. Урахування пріоритетів.

Розділ 4 Тематичний план навчальної дисципліни

Назва теми (лекції) та питання теми (лекції)	Кіль- кість годин	Назва теми та питання семінарського, практичного або лабораторного заняття	Кіль- кість годин	Завдання самостійної роботи в розрізі тем	Кіль- кість годин
Модуль 1. Основи ризик менеджменту					
Тема 1. Управління ризиком у діяльності економічних систем Лекція 1 1. Вступ. Основні поняття. 2. Види суб'єктів ризику. 3. Невизначеність та ризик. Причини виникнення невизначеності та ієрархія її видів. 4. Критерії оцінювання ризиків	2	Практична робота 1. Візуалізація ризиків. Практична робота 2. Візуалізація ризиків. Практична робота 3. Візуалізація ризиків.	2 2 2	Виконати індивідуальні завдання. Підготувати довідку на тему: «Методичні основи оцінки ризиків підприємницьк ої діяльності».	17
Тема 2. Застосування теорії корисності в управлінні економічними ризиками Лекція 2 1. Основні визначення концепції корисності.	2	Практична робота 4-5. Ризик і теорія корисності. Практична робота 6. Поточна	4	Дати відповіді на питання самоконтролю знань. Виконати індивідуальні	10

Назва теми (лекції) та питання теми (лекції)	Кіль- кість годин	Назва теми та питання семінарського, практичного або лабораторного заняття	Кіль- кість годин	Завдання самостійної роботи в розрізі тем	Кіль- кість годин
2. Інформаційна ситуація та критерії оцінювання. 3. Критерії прийняття рішень. Приклади.					
Тема 6. Експертні методи оцінювання ризику. Лекція 8 1. Основні поняття. 2. Загальна схема експертних опитувань. 3. Переваги / недоліки експертного методу при оцінці ризиків. 4. Цілі індивідуальних експертних оцінок. 5. Типи групових експертних процедур. 6. Етапи методу рангової кореляції. 7. Метод експертних листів. 8. Приклади.	2	Практична робота 12-13. Управління ризиками на основі експертного оцінювання.	4	Виконати тести самоконтролю знань. Виконати індивідуальні завдання.	15
Тема 7. Моделювання економічного ризику на основі концепції теорії ігор Лекція 9 1. Історія становлення концепції. 2. Основні поняття теорії ігор. 3. Класифікація ігор. 4. Гра-підприємництво.	2	Практична робота 14. Матриця ризику (платіжні матриці). Практична робота 15. Поточна модульна робота	2 2	Виконати тести самоконтролю знань. Виконати індивідуальні завдання. Розробити «Гру»	24
Разом	16		32		72

Розділ 5. Система оцінювання знань студентів

Таблиця 5 – Розподіл балів за результатами вивчення навчальної дисципліни

Види робіт	Максимальна кількість балів
Модуль 1 (Т1-Т2): тести (10 балів), практичні роботи (5 балів), індивідуальні завдання (5 бали), поточна модульна робота (10 балів)	30
Модуль 2 (Т3-Т7): тести (20 бали), практичні роботи (10 балів), індивідуальні завдання (10 балів), поточна модульна робота (10 балів) Підсумкове тестування	30
Екзамен	40
Разом	100

Система нарахування додаткових балів за видами робіт з вивчення навчальної дисципліни

Форма роботи	Вид роботи	Бали
1. Навчальна	Виконання індивідуальних навчально-дослідних завдань підвищеної складності	10
2. Науково-дослідна	1. Участь у наукових гуртках	10
	2. Участь в наукових студентських конференціях: університетських, міжвузівських, всеукраїнських, міжнародних	20

За додаткові види навчальних робіт студент може отримати не більше 30 балів. Додаткові бали додаються до загальної підсумкової оцінки за вивчення навчальної дисципліни, але загальна підсумкова оцінка не може перевищувати 100 балів

Таблиця 6 – Шкала оцінювання знань здобувачів вищої освіти за результатами вивчення навчальної дисципліни

Сума балів за всі види навчальної діяльності	Оцінка за шкалою ЄКТС	Оцінка за національною шкалою
90–100	A	Відмінно
82–89	B	Дуже добре
74–81	C	Добре
64–73	D	Задовільно
60–63	E	Задовільно достатньо
35–59	FX	Незадовільно з можливістю проведення

		повторного підсумкового контролю
0–34	F	Незадовільно з обов'язковим повторним вивченням навчальної дисципліни та проведенням підсумкового контролю

Розділ 6. Інформаційні джерела

1. Бугріменко Р.М., Смірнова П.В. Ризикологія: навч. посіб. Харків: ТОВ «Видавництво «Форт», 2022. 148 с
2. Долінський Л. Фінансовий ризик-менеджмент : навч. посіб. Київ : НаУКМА, 2022. 132 с.
3. Економічні ризики та методи їх вимірювання: рекомендації до вивчення дисципліни [Електронний ресурс] : навч. посіб. для здобувачів ступеня бакалавра за освітньою програмою «Економіка бізнес-підприємства» спеціальності 051 «Економіка» / КПІ ім. Ігоря Сікорського; уклад. О.В. Кривда – Електронні текстові дані (1 файл: 354 Кбайт). – Київ : КПІ ім. Ігоря Сікорського, 2022. – 85 с.
4. Економічні ризики: методи вимірювання та управління: Навчальний посібник / Скопенко Н.С., Федулова І.В., Мазник Л.В., Кириченко О.М., Удворгелі Л.І.; за заг. ред. Скопенко Н.С. Київ : НУХТ, 2021. 344 с.
5. Кононенко Ж. А., Ходаківська Л. О., Грибовська Ю. М. Економічна інформація як інструмент управління підприємством. Modern Economics. 2020. № 19. С. 83 – 87. URL: <https://modecon.mnau.edu.ua/issue/19-2020/kononenko.pdf>.
6. Єгорова О.В., Дорошенко А.П., Кононенко Ж.А. Фактори розвитку фінансової кризи аграрних підприємств. Modern economics. 2020. № 20(2020). С. 99-104. DOI: [https://doi.org/10.31521/modecon.V20\(2020\)-16](https://doi.org/10.31521/modecon.V20(2020)-16). URL: <https://modecon.mnau.edu.ua/en/factors-of-the-development-of/>.
7. Кононенко Ж.А., Миколенко І.Г., Яковенко Т.І. Карнаухова Г.В. Критерії забезпечення достовірності даних в аналітичній діяльності. Український журнал прикладної економіки і техніки. № 2, 2024. DOI: <https://doi.org/10.36887/2415-8453-2024-2-37>
8. Перебийніс В.І., Кононенко Ж.А., Карнаухова Г.В. Конкурентні переваги суб'єктів господарювання: формування, моделювання, детермінанти. Інфраструктура ринку. № 78, 2024. DOI: <https://doi.org/10.32782/infrastructure78-5>
9. Кононенко Ж.А., Миколенко І.Г., Яковенко Т.І. Аналітичні інструменти в економічних дослідженнях конкурентного середовища підприємства. Проблеми економіки. № 2, 2024. DOI: <https://doi.org/10.32983/2222-0712-2024-2-136-142>
10. Офіційний сайт департаменту статистики Організації Об'єднаних Націй URL: <http://unstats.un.org/unsd/default.htm>
11. Офіційний сайт державної служби статистики України. URL: <http://www.ukrstat.gov.ua/>.
12. Полінкевич О. М., Волинець І. Г. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання ризиків: навч. посіб. Луцьк : Вежа-Друк, 2018. 336 с. URL: http://www.esnuir.eenu.edu.ua/bitstream/123456789/15846/1/Polinkevych_Volynets_OGRO R2018.pdf
13. Старостіна А.О., Кравченко В.А. Ризик-менеджмент: теорія та практика: навч. посіб. К.: ІВЦ «Видавництво «Політехніка», 2018. 200 с.
14. Управління економічними ризиками підприємств : навч. посіб. О. В. Балусева, І. В. Моргачов, О. В. Корнілова ; Донец. держ. ун-т упр., Східноукр. нац. ун-т ім. Володимира Даля. Кременчук : Щербатих О. В., 2020. 286 с.
15. Управління ризиками та безпека бізнесу : навч. посіб. / [В. П. Іващенко, І. М. Фріман, Є. М. Фріман] ; Нац. металург. акад. України. Дніпро : Акцент, 2020. 142 с.

16. Формування механізму управління ризиками переробних підприємств : монографія / І. М. Посохов [та ін.]; Нац. техн. ун-т «Харків. політехн. ін-т». Харків : Іванченко І. С., 2022. 278 с.
17. Шишкіна О. В. Механізм управління фінансовими ризиками промислових підприємств: теорія, методологія, практика : монографія; Чернігів. нац. технол. ун-т. Чернігів : ЧНТУ, 2020. 317 с.
18. Яковенко О. І. Управління проектами та ризиками] : навч. посіб. Ніжин : Лисенко М. М., 2019. 194 с.
19. Christian B. Smart. Solving for Project Risk Management, McGraw Hill; 1st edition, 2020. 320 p.
20. Gerardus Blokdyk. Risk Management A Complete Guide. 5STARCook, 2020. 312 p.
21. Hongmu Lee. Risk Management. Fundamentals, Theory, and Practice in Asia. Springer Singapore, 2021. 242 p. DOI: <https://doi.org/10.1007/978-981-16-3468-0> URL: <https://link.springer.com/book/10.1007/978-981-16-3468-0>
22. Stepanov Vn. «Challenge» as a fundamental category of the national security and riskology. Economic innovations 20.2 (67) (2018): 183-189.
23. Stepanov, V. N. Riskology: foundations, applications, thesaurus: monograph [Riskologiya: osnovaniya, prilozeniya, tezaurus: monografiya]. IPREEI NANU, Odessa. 2019. 292p.

Розділ 7. Програмне забезпечення навчальної дисципліни

- Пакет програмних продуктів Microsoft Office.
- Дистанційний курс з навчальної дисципліни на платформі «Moodle».

Політика вивчення навчальної дисципліни та оцінювання

Політика оцінювання здобувачів вищої освіти. Роботи, які здаються із порушенням термінів без поважних причин, оцінюються на нижчу оцінку (75% від можливої максимальної кількості балів за вид діяльності). Перескладання модулів відбувається із дозволу провідного викладача за наявності поважних причин (наприклад, лікарняний).

[Положення про організацію освітнього процесу](#)

[Положення про порядок та критерії оцінювання знань, вмінь та навичок здобувачів вищої освіти](#)

[Порядок ліквідації здобувачами вищої освіти академічної заборгованості](#)

Політика щодо відвідування. Відвідування занять є обов'язковим компонентом. За об'єктивних причин (наприклад, хвороба, працевлаштування, міжнародне стажування) навчання може відбуватись в режимі он-лайн.

Політика щодо академічної доброчесності. Здобувач повинен дотримуватися принципів академічної доброчесності, зокрема недопущення академічного плагіату, фальсифікації, фабрикації, списування під час поточного, рубіжного та підсумкового контролю.

Списування під час контрольних робіт та поточних тестів заборонені (в т.ч. із використанням мобільних девайсів). Мобільні пристрої дозволяється використовувати лише під час он-лайн тестування та підготовки практичних завдань в процесі заняття. В ПУЕТ діють:

[Кодекс честі студента](#)

[Положення про академічну доброчесність](#)

[Положення про запобігання випадків академічного плагіату](#)

Політика визнання результатів навчання визначена такими документами:

[Положення про порядок перезарахування результатів навчання, здобутих в іноземних та вітчизняних закладах освіти](#)

[Положення про академічну мобільність здобувачів вищої освіти](#)

[Положення про порядок визнання результатів навчання здобутих шляхом неформальної та/або інформальної освіти; *інфографіка*](#) (розділ Освіта/Організація освітнього процесу/Неформальна освіта)

Політика вирішення конфліктних ситуацій:

[Положення про правила вирішення конфліктних ситуацій](#)

[Положення про апеляцію результатів підсумкового контролю у формі екзамену](#)

[Уповноважена особа з питань запобігання та виявлення корупції](#)

Політика підтримки учасників освітнього процесу:

[Положення про психологічну службу Полтавського університету економіки і торгівлі](#)

[Психологічна служба](#)

[Положення про студентського омбудсмена](#)

[Студентський омбудсмен \(Уповноважений з прав студентів\) ПУЕТ](#)

[Уповноважений з прав корупції](#)

Безпека освітнього середовища:

Інформація про безпечність освітнього середовища ПУЕТ наведена у вкладці [«Безпека життєдіяльності»](#)