

# Чернівецький національний університет імені Юрія Федьковича

(повне найменування закладу вищої освіти)

економічного факультету

(назва інституту/факультету)

Кафедра економіко-математичного моделювання

(назва кафедри)

## СИЛАБУС

навчальної дисципліни

Моделі ризик-менеджменту

(вказати назву навчальної дисципліни (іноземною, якщо дисципліна викладається іноземною мовою))

вибіркова

(вказати: обов'язкова)

Освітньо-професійна програма Інформаційні технології та моделювання в економіці

(назва програми)

Спеціальність 051 Економіка

(вказати: код, назва)

Галузь знань 05 «Соціальні та поведінкові науки»

(вказати: шифр, назва)

Рівень вищої освіти другий (магістерський)

(вказати: перший (бакалаврський)/другий (магістерський)/третій (освітньо-науковий))

економічний факультет

(назва факультету/інституту, на якому здійснюється підготовка фахівців за вказаною освітньо-професійною програмою)

Мова навчання українська

(вказати: на яких мовах читається дисципліна)

<https://emm.cv.ua/teachers/makhanets/>

Розробники: Маханець Л.Л., доцент кафедри економіко-математичного моделювання,

к.е.н.

(вказати авторів (викладач (ів)), їхні посади, наукові ступені, вчені звання)

Профайл викладача (-ів) <https://emm.cv.ua/teachers/makhanets/>

Контактний тел. +380372526847

E-mail: [l.makhanets@chnu.edu.ua](mailto:l.makhanets@chnu.edu.ua)

Сторінка курсу в Moodle <https://moodle.chnu.edu.ua/course/view.php?id=3913>

Консультації Згідно графіку

### **1. Анотація дисципліни (призначення навчальної дисципліни).**

Вироблення у майбутніх фахівців глибокого розуміння сутності ризикованих економічних процесів, гнучкого професійного мислення, опануванню сучасної методології аналізу ризику та прийняття раціональних рішень, стратегії і тактики антикризового управління економічним об'єктом за реальних умов реалізації.

### **2. Мета навчальної дисципліни:**

Формування фахових компетенцій щодо виявлення, оцінювання та управління ризиками у процесі засвоєння теоретичних та практичних аспектів ризик-менеджменту та набуття практичних навиків розробки та реалізації заходів попередження, зниження рівня ризику а також використання ризику в цілях нарощення капіталу підприємства та максимізації його прибутку.

### **3. Пререквізити.**

Базові знання з дисциплін: “Економічна теорія”, “Економіка підприємства”, “Вища математика” та “Економетрика”.

### **4. Результати навчання**

Відповідно до освітньо-професійної програми підготовки магістрів галузі знань 05 Соціальні та поведінкові науки за спеціальністю 051 Економіка (освітня програма: “Інформаційні технології та моделювання в економіці”) вивчення дисципліни сприяє формуванню компетентностей та програмних результатів навчання:

#### ***Загальні та фахові компетентності***

ЗК2 Здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу.

ЗК6. Здатність розробляти та управляти проектами.

ЗК8. Здатність проводити дослідження на відповідному рівні

СК1. Здатність застосовувати науковий, аналітичний, методичний інструментарій для обґрунтування стратегії розвитку економічних суб'єктів та пов'язаних з цим управлінських рішень.

СК3. Здатність збирати, аналізувати та обробляти статистичні дані, науково-аналітичні матеріали, які необхідні для розв'язання комплексних економічних проблем, робити на їх основі обґрунтовані висновки.

СК4. Здатність використовувати сучасні інформаційні технології, методи та прийоми дослідження економічних та соціальних процесів, адекватні встановленим потребам дослідження.

СК8. Здатність оцінювати можливі ризики, соціально економічні наслідки управлінських рішень.

СК 18. Здатність використовувати моделі прийняття рішень для підготовки рішень в умовах конфлікту та нечіткої інформації.

#### ***Результати навчання:***

ПРН 1. Формулювати, аналізувати та синтезувати рішення науково-практичних проблем.

ПРН 2 Розробляти, обґрунтовувати і приймати ефективні рішення з питань розвитку соціально-економічних систем та управління суб'єктами економічної діяльності

ПРН 4. Розробляти соціально-економічні проекти та систему комплексних дій щодо їх реалізації з урахуванням їх цілей, очікуваних соціально-економічних наслідків, ризиків, законодавчих, ресурсних та інших обмежень.

ПРН 7. Обирати ефективні методи управління економічною діяльністю, обґрунтовувати пропоновані рішення на основі релевантних даних та наукових і прикладних досліджень.

ПРН 8 Збирати, обробляти та аналізувати статистичні дані, науково-аналітичні матеріали, необхідні для вирішення комплексних економічних завдань.

ПРН 9. Приймати ефективні рішення за невизначених умов і вимог, що потребують застосування нових підходів, методів та інструментарію соціально-економічних досліджень.

ПРН 12. Обґрунтовувати управлінські рішення щодо ефективного розвитку суб'єктів господарювання, враховуючи цілі, ресурси, обмеження та ризики.

ПРН 13 Оцінювати можливі ризики, соціально-економічні наслідки управлінських рішень.

ПРН 22. Застосовувати моделі прийняття рішень у розробці управлінських рішень в умовах конфлікту та нечіткої інформації.

## 5. Опис навчальної дисципліни

### 5.1. Загальна інформація

Форма навчання	Рік підготовки	Семестр	Кількість			Кількість годин						Вид підсумкового контролю
			кредитів	годин	змістових модулів	лекції	практичні	семинарські	лабораторні	самостійна робота	індивідуальні завдання	
Денна	2-й	3	4	120	2	21			14	85		Залік
Заочна	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–

### 5.2. Дидактична карта навчальної дисципліни

Назви змістових модулів і тем	Кількість годин												
	денна форма							Заочна форма					
	усього	у тому числі					усього	у тому числі					
		л	п	лаб	інд	с.р.		л	п	лаб	інд	с.р.	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	
<b>Змістовий модуль 1. Теоретичні основи ризик-менеджменту</b>													
Тема 1. Сутність та принципи концепції ризик-менеджменту	11	2				9							
Тема 2. Засади системного аналізу ризику	13	2		1		10							
Тема 3. Методологічні засади й інструментарій кількісного оцінювання ступеня ризику	14	3		2		9							
Тема 4. Програма управління ризиками	13	2		1		10							
<b>Разом за ЗМ1</b>	<b>51</b>	<b>9</b>		<b>4</b>		<b>38</b>							
<b>Змістовий модуль 2. Прикладні аспекти ризик-менеджменту</b>													
Тема 5. Операційний ризик-менеджмент	14	3		2		9							
Тема 6. Ризик-менеджмент у сфері фінансів	14	3		2		9							
Тема 7. Ризик-менеджмент у сфері маркетингу	13	2		2		9							
Тема 8. Ризик-менеджмент у зовнішньоекономічній діяльності	14	2		2		10							
Тема 9. Використання спеціалізованого	14	2		2		10							

програмного забезпечення у сфері ризик менеджменту												
<b>Разом за ЗМ2</b>	<b>69</b>	<b>12</b>		<b>10</b>		<b>47</b>						
<b>Усього годин</b>	<b>120</b>	<b>21</b>		<b>14</b>		<b>85</b>						

## 6. Методи навчання, форми та методи оцінювання

### Методи навчання

MН1 – словесні методи (лекція, дискусія, бесіда, консультація тощо).

MН2 – практичні методи (практичні або лабораторні роботи).

MН3 – бізнес-кейси (індивідуальні або командні) .

MН4 – наочні методи (презентації результатів виконаних завдань, ілюстрації, відеоматеріали, тощо).

MН7 – самостійна робота над індивідуальним завданням або за програмою навчальної дисципліни.

### Форми та методи оцінювання

MO1 – контрольні роботи (тематичні, модульні).

MO2 – тести, опитування, самостійні роботи за індивідуальними завданнями.

MO3 – захист бізнес-кейсів, результатів досліджень.

MO4 – аналітичні звіти, реферати, тези доповідей, статті.

MO5 – презентації результатів виконання завдань.

MO6 – оцінювання завдань лабораторних робіт.

MO8 – підсумковий контроль –залік.

MO11 – інші види індивідуальних та групових завдань.

### Критерії оцінювання результатів навчання з навчальної дисципліни

**Політика щодо дедлайнів та перескладання:** Роботи, які здаються із порушенням термінів без поважних причин, оцінюються на нижчу оцінку (-10 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.

Критеріями оцінювання є:

**при усних відповідях:** повнота розкриття питання; логіка викладання матеріалу; використання основної та додаткової літератури; аналітичні міркування, уміння робити порівняння, висновки; уміння аналізувати теоретичні проблеми з урахуванням світової і вітчизняної практики;

**при виконанні письмових завдань:** повнота розкриття питання, аргументованість і логіка викладання матеріалу, використання літературних джерел, законодавчих актів, прикладів та фактичного матеріалу тощо; цілісність, системність, логічність, уміння формулювати висновки; акуратність оформлення письмової роботи.

Максимальна оцінка знань студента під час навчальних занять за кожну тему (опитування, тестування, розв'язання задач), виконанні завдань для самостійної роботи, підготовці есе – 5 балів.

Проведення підсумкового контролю здійснюється у формі екзамену в обсязі навчального матеріалу, визначеного навчальною програмою дисципліни і в терміни, передбачені графіком навчального процесу. Загальна підсумкова оцінка з дисципліни (максимум 100 балів) визначається як сума балів поточного і модульного контролю та результатів екзамену (як можливість отримання додаткових балів, якщо набрані протягом семестру бали не влаштовують студентів). У випадку отримання менше 50 балів за результатами загального підсумкового контролю, студент обов'язково здійснює перескладання для ліквідації академічної заборгованості.

### Шкала оцінювання: національна та ЄКТС

Оцінка за національною шкалою	Оцінка за шкалою ECTS	
	Оцінка (бали)	Пояснення за розширеною шкалою
<b>Відмінно</b>	A (90-100)	відмінно
<b>Добре</b>	B (80-89)	дуже добре
	C (70-79)	добре
<b>Задовільно</b>	D (60-69)	задовільно
	E (50-59)	достатньо
<b>Незадовільно</b>	FX (35-49)	(незадовільно) з можливістю повторного складання
	F (1-34)	(незадовільно) з обов'язковим повторним курсом

### Розподіл балів, які отримують студенти

Поточне тестування та самостійна робота									Залік	Сума
Змістовий модуль №1				Змістовий модуль №2						
T1	T2	T3	T4	T5	T6	T7	T8	T9		
5	6	8	7	6	7	7	7	6	40	100

### 7. Рекомендована література – основна

- Боровик М. В. Ризик-менеджмент : конспект лекцій для студентів магістратури усіх форм навчання спеціальності 073 – Менеджмент / М. В. Боровик ; Харків. нац. ун-т міськ. госп-ва ім. О. М. Бекетова. – Харків : ХНУМГ ім. О. М. Бекетова, 2018. – 65 с.
- Ризик-менеджмент: навчальний посібник для здобувачів спец. 051 «Економіка» та 073 «Менеджмент» /З.Д. Калініченко. – Дніпро: ДДУВС, 2021. – 224 с.
- Ризик-менеджмент у фінансовій сфері: навч. посібник / МОН України, Уманський ДПУ імені Павла Тичини; уклад. М.А. Слатвінський. – Умань: Візаві, 2017. – 395 с.
- Савчук В. Основы риск-менеджмента предприятий. – Киев: Баланс Бизнес Букс, 2019. – 280 с.

### Рекомендована література –додаткова

- Матвійчук А.В. Аналіз і управління економічним ризиком: Навч. посібник. – К.: Центр навчальної літератури, 2005. – 224 с.
- Вітлінський В.В. Аналіз, оцінка і моделювання економічного ризику.- К.: Деміур, 1996. –212с.
- Вітлінський В.В., Верченко П.І. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком: Навч.-метод. посібник для самост. вивч. дисц.-К.: КНЕУ, 2000.-292с.
- Вітлінський В.В., Маханець Л.Л. Ризикологія в зовнішньоекономічній діяльності: Навч. посіб. – К.: КНЕУ, 2008. – 432 с.
- Вітлінський В.В., Наконечний С.І. Ризик у менеджменті. – К.: ТОВ Борисфен-М, 1996. –336с.
- Маханець Л.Л., Скращук Л.В., Іванова Н.Я., Кибич Г.П. Економічний ризик: практикум. – Чернівці: ЧНУ,2011. – 76 с.
- Верченко П. І., Великоіваненко Г. І., Демчук Н. В. та ін. Ризикологія: Навч.-метод. посіб. для самост. вивч. дисц. – К.: КНЕУ, 2006. – 176 с.

### Інформаційні ресурси

- Офіційний сайт Міністерства економіки України <http://www.me.gov.ua>.
- Офіційний сайт Міністерства фінансів України <http://www.minfin.gov.ua>.
- Офіційний сайт Державного Казначейства України <http://www.treasury.gov.ua>.
- Офіційний сайт Кабінету Міністрів України <http://www.kmu.gov.ua>.
- Офіційний сайт Державного комітету статистики України <http://www.ukrstat.gov.ua>.