

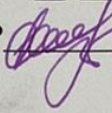
МІНІСТЕРСТВО ФІНАНСІВ УКРАЇНИ
ДЕРЖАВНИЙ ПОДАТКОВИЙ УНІВЕРСИТЕТ

Факультет податкової справи, обліку та аудиту
Кафедра облікових технологій та бізнес-аналітики

Затверджено

Науково-методичною радою Університету

протокол від « 18 » 08 2022 р. № 7

Голова НМР  Світлана СУПРУНЕНКО

**Робоча програма
навчальної дисципліни
«Ризикологія»**

для підготовки здобувачів вищої освіти першого (бакалаврського) рівня
денної та заочної форми навчання
галузь знань 07 Управління та адміністрування
спеціальність 071 «Облік і оподаткування»
ОПП «Облік, податковий аудит та бізнес-аналітика»
ОПП «Податкове консультування»
Статус дисципліни: вибіркова

Ірпінь – 2022

Робоча програма навчальної дисципліни «Ризикологія» складена на основі освітньо-професійних програм «Облік, податковий аудит та бізнес-аналітика», «Податкове консультування» першого (бакалаврського) освітнього рівня, спеціальності 071 «Облік і оподаткування», затверджена Вченою радою 26.04 2021 року, протокол № 5.

Укладачі:

Н. В. Параниця, доцент, к.е.н., доцент кафедри облікових технологій та бізнес-аналітики

Рецензенти:

Т. Паянок, доцент, к.е.н., доцент кафедри облікових технологій та бізнес – аналітики

А. Савченко, доцент, к.е.н., доцент кафедри аудиту, державного фінансового контролю та аналізу

Гаранти освітніх програм

А. Савченко, к.е.н., доцент

Ю. Панура, к.е.н., доцент

Робочу програму навчальної дисципліни розглянуто та схвалено кафедрою облікових технологій та бізнес-аналітики, протокол від «03» 08 2022 р. № 1.

Завідувач кафедри

Т. Паянок, доцент, к.е.н.

Розглянуто і схвалено вченою радою факультету податкової справи, обліку та аудиту, протокол від «16» 08. 2022 р. № 1.

Голова вченої ради

факультету податкової справи, обліку та аудиту

В. Краєвський, професор, д.е.н.

За Завідувача сектору навчально-методичного з забезпечення освітнього процесу

С. Меднікова

ЗМІСТ

1. ПЕРЕДМОВА	5
2. ОПИС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ	6
2.1. Перелік компетентностей, формування яких забезпечує вивчення дисципліни	6
2.2. Результати навчання	7
2.3. Пререквізити та постреквізити вивчення дисципліни	7
2.4. Структура навчальної дисципліни	7
3. ЗМІСТ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ ЗА ЗМІСТОВНИМИ МОДУЛЯМИ	8
4. КРИТЕРІЇ ОЦІНЮВАННЯ	15
5. ЗАСОБИ ОЦІНЮВАННЯ	19
6. ФОРМИ ТА ПЕРЕЛІК ПИТАНЬ ДО ПОТОЧНОГО ТА ПІДСУМКОВОГО КОНТРОЛЮ	19
7. РЕКОМЕНДОВАНА ЛІТЕРАТУРА	22

1. ПЕРЕДМОВА

Прийняття обґрунтованих управлінських рішень є необхідною умовою ефективною діяльності економічних об'єктів будь-якого рівня в будь-якій економічній системі, особливо в умовах ринку і формування соціально-орієнтованої економіки. Нестабільність зовнішнього і внутрішнього середовища діяльності економічних об'єктів, інтенсивний розвиток економіки, невизначеність процесів формування і розвитку більшості факторів економічного розвитку вимагають глибокого обґрунтування та підвищення ефективності управлінських рішень на основі використання сучасних теорій, методологій та технологій прийняття рішень.

Мета навчальної дисципліни «Ризикологія» є задоволення потреби майбутніх фахівців з економіки і підприємництва в знаннях у сфері системного аналізу економічного ризику на основі формування знань щодо методології та інструментарію виявлення, оцінки рівня та аналізу ризику в економіці, його моделювання, оптимізації та управління; підвищення рівня фундаментальної математичної підготовки в контексті підсилення її прикладної спрямованості; вироблення умінь та навичок застосовувати різні пакети прикладних програм для побудови математичних моделей економічних процесів з врахуванням ризику; підготовка фахівців сучасного рівня кваліфікації, який забезпечить йому конкурентну спроможність як на національному, так і міжнародному ринку праці.

Завдання навчальної дисципліни:

- розширення й поглиблення знань про якісні та кількісні властивості економічних процесів з урахуванням ризику;
- опанування методології та методики побудови, аналізу й застосування економіко-математичних моделей, що описують та враховують ризик;
- вивчення низки найтипівіших прийомів аналізу, моделювання та вимірювання економічного ризику в процесі прийняття рішень, опанування відповідною сукупністю інструментів з метою практичного використання в різноманітних економічних сферах;
- вироблення умінь та навичок застосовувати спеціальні пакети прикладних програм для побудови та дослідження моделей які враховують та описують економічний ризик.
- методи пошуку наукової інформації і аналізу обробки емпіричних даних з використанням комп'ютерних технологій, в основному ґрунтується на можливостях програмного комплексу Microsoft Excel.

Методи та форми навчання.

Методи навчання – способи досягнення навчальної мети, система послідовних взаємодій викладача й здобувачів вищої освіти, які забезпечують засвоєння змісту.

В процесі вивчення дисципліни використовуються словесні, наочні, практичні методи навчання, індивідуально-консультаційна робота під керівництвом викладача, самостійна робота.

Методи стимулювання й мотивації навчально-пізнавальної діяльності: метод стимулювання обов'язку та відповідальності.

Методи контролю за ефективністю навчально-пізнавальної діяльності: усного контролю, письмовий, тестовий, контрольна перевірка, диференційований залік.

Форми навчання – денна, заочна.

Форми організації навчання – спосіб організації навчальної діяльності, який регулюється певним, наперед визначеним розпорядком.

Форми організації занять: практичні заняття, самостійна робота, індивідуально-консультаційна робота, контрольні заходи, застосування інформаційних технологій та елементи дистанційного навчання у системі Moodle.

Організація поточного та підсумкового контролю знань.

Контрольні заходи включають в себе:

– поточний контроль знань, що здійснюється протягом семестру під час проведення практичних, індивідуальних занять, а також самостійної роботи та є засобом виявлення ступеня сприйняття (засвоєння) навчального матеріалу. Проводиться у формі усного опитування, письмових тестів, вирішення практичних завдань, захисту індивідуальної роботи, експрес-опитування;

– модульний контроль знань, що проводиться з урахуванням поточного контролю за відповідний змістовий модуль і має на меті інтегровану оцінку результатів навчання здобувача після вивчення матеріалу з логічно завершеної частини дисципліни – змістового модуля.

Проводиться у формі модульної контрольної роботи – (колоквіум);

– підсумковий контроль знань: проводиться у формах семестрового диференційованого заліку з навчальної дисципліни «Ризикологія» в обсязі навчального матеріалу, визначеного навчальною програмою, і в терміни, встановлені навчальним планом та графіком освітнього процесу.

Здобувач вищої освіти вважається допущеним до підсумкового контролю з навчальної дисципліни «Ризикологія» (семестрового диференційованого заліку), якщо він виконав всі види робіт, передбачені навчальним планом на семестр з цієї навчальної дисципліни.

2. ОПИС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Найменування показників	Рівень вищої освіти, галузь знань, спеціальність, ОПП	Характеристика навчальної дисципліни	
		денна форма навчання	заочна форма навчання
Кількість кредитів – 3	Рівень вищої освіти: перший (бакалаврський)	за вибором	
Модулів – 2	Галузь знань 07 «Управління та адміністрування»	Рік підготовки:	
Змістовних модулів – 2		1/3-й	1/3-й
Загальна кількість годин – 90		Семестр	
	Спеціальність 071 «Облік і оподаткування» Освітня програма «Облік, податковий аудит та бізнес-аналітика»	Лекції	
		20 год.	4 год
		Лабораторні заняття	
		16 год.	2 год
		Самостійна робота	
		52 год.	82 год
		Індивідуально-консультаційна робота:	
		2 год.	2 год
		Форма семестрового контролю: диференційований залік	

2.1. ПЕРЕЛІК КОМПЕТЕНТНОСТЕЙ, ФОРМУВАННЯХ ЯКИХ ЗАБЕЗПЕЧУЄ ВИВЧЕННЯ ДИСЦИПЛІНИ

Після вивчення курсу «Ризикологія» здобувачі вищої освіти повинні володіти такими компетентностями:

Інтегральна компетентність: Здатність розв'язувати складні спеціалізовані задачі та практичні проблеми під час професійної діяльності у сфері обліку, аудиту та оподаткування або в процесі навчання, що передбачає застосування теорій та методів економічної науки і характеризується комплексністю й невизначеністю умов.

Загальні компетентності:

Здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу.

Здатність працювати в команді.

Здатність працювати автономно.

Спеціальні (фахові, предметні) компетентності

Використовувати математичний інструментарій для дослідження соціально-економічних процесів, розв'язання прикладних завдань в сфері обліку, аналізу, контролю, аудиту, оподаткування.

Ідентифікувати та оцінювати ризики не досягнення управлінських цілей суб'єкта господарювання, не дотримання ним законодавства та регулювання діяльності, не достовірності звітності, збереження й використання його ресурсів.

2.2. РЕЗУЛЬТАТИ НАВЧАННЯ

Результати поточного контролю обов'язково відображаються викладачами у «електронному журналі» модулю «Деканат» Автоматизованої системи управління «Управління університетом». Порядок ведення електронного журналу регламентується відповідним наказом ректора.

Програмними результатами навчання є:

Знання та розуміння:

Ідентифікувати та оцінювати ризики господарської діяльності підприємств.

Застосування знань та розумінь:

Володіти загальнонауковими та спеціальними методами дослідження соціально-економічних явищ і господарських процесів на підприємстві.

2.3. ПЕРЕКВІЗИТИ ТА ПОСТРЕКВІЗИТИ ВИВЧЕННЯ ДИСЦИПЛІНИ

Передумовами вивчення дисципліни є: «Економічна теорія (макроекономіка)», «Міжнародна економіка», «Статистика», «Економетрика».

Постреквізити вивчення дисципліни є: «Державні фінанси», «Аналіз в бюджетних установах».

2.4. СТРУКТУРА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ**«Ризикологія»**

галузь знань 07 Управління та адміністрування

спеціальність 071 «Облік і оподаткування»

№ з/п	Змістові модулі	Кількість годин (денна / заочна форма навчання)				
		Лекційні заняття	Лабораторні заняття	Інд.-конс. робота під керівництвом викладача	Самостійна робота	Всього
Модуль 1 = 1,5 залікових кредити (45 год.)						
ЗМ 1 (Теми 1-6)						
Господарські рішення у різних сферах підприємницької діяльності						
T1	Сутнісна характеристика господарських рішень. Технологія прийняття рішень господарської діяльності.	1 / -	- / -	- / -	5 / 6	6 / 6
T2	Методичні основи розроблення та обґрунтування господарських рішень.	1 / 1	- / -	- / -	4 / 5	5 / 6
T3	Прогнозування та аналіз господарських рішень.	2 / -	2 / -	- / -	4 / 8	8 / 8
T4	Прийняття рішень в умовах невизначеності.	2 / -	2 / -	1 / -	4 / 8	9 / 8
T5	Застосування теорія корисності в процесах прийняття рішень.	2 / 1	2 / 1	- / 1	4 / 6	8 / 9
T6	Вплив підприємницьких ризиків на прийняття господарських рішень.	2 / -	2 / -	- / -	4 / 8	8 / 8
<i>Контрольна робота №1</i>						
Всього за Модулем 1		10 / 2	8 / 1	1 / 1	25 / 41	45
Модуль 2 = 1,5 залікових кредити (45 год.)						
ЗМ 2 (Теми 7-12)						
Ризик та невизначеність в обґрунтуванні господарських рішень						
T7	Критерії прийняття господарських рішень за умов ризику.	2 / -	1 / -	- / -	4 / 6	7 / 6
T8	Прийняття рішень у конфліктних ситуаціях.	2 / 1	2 / -	- / -	4 / 5	8 / 6
T9	Обґрунтування фінансових та інвестиційних рішень за умов ризику.	2 / -	1 / 1	- / -	6 / 7	9 / 8
T10	Якісне та кількісне оцінювання підприємницьких ризиків.	2 / -	1 / -	1 / 1	6 / 7	10 / 8
T11	Основи ризик-менеджменту.	1 / -	2 / -	- / -	3 / 8	6 / 8
T12	Напрями і методи регулювання та зниження ступеня ризику.	1 / 1	1 / -	- / -	4 / 8	6 / 9
<i>Контрольна робота №2</i>						

Всього за Модулем 2	10 / 2	8 / 1	1 / 1	27 / 41	45
Форма підсумкового контролю - диференційований залік					
РАЗОМ ГОДИН З КУРСУ	20 / 4	16 / 2	2 / 2	52 / 82	90

3. ЗМІСТ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ ЗА ЗМІСТОВНИМИ МОДУЛЯМИ
Змістовий модуль 1. Господарські рішення у різних сферах підприємницької діяльності
ТЕМА 1. Сутнісна характеристика господарських рішень. Технологія прийняття господарських рішень

План лекційного заняття

1. Господарські рішення та їх ознаки.
2. Класифікація господарських рішень.
3. Способи формалізації та реалізації господарських рішень.
4. Якість і ефективність господарських рішень.

План самостійної роботи здобувачів вищої освіти

1. Основні вимоги та умови досягнення господарських рішень.
2. Основні форми вираження господарських рішень.
3. Оптиміальні сполучення форм розроблення та реалізації господарських рішень.
4. Основні параметри та показники якісного господарського рішення.
5. Принципи оцінки ефективності господарських рішень.

Перелік питань для самоконтролю

1. Поняття господарських рішень та їх ознаки.
2. Сутність господарських рішень та їх види.
3. Вимоги до господарських рішень та умови їх досягнення.
4. Способи формалізації та реалізації господарських рішень.
5. Визначення оптимальних форм представлення та реалізації господарських рішень.
6. Якість та ефективність господарських рішень.
7. Основні параметри та показники якісного рішення.
8. Основні умови забезпечення якості господарського рішення.
9. Принципи оцінки ефективності господарських рішень.

Рекомендована література:

- основна [1-4];
допоміжна [1, 4];
інформаційні ресурси Інтернет [2, 5];
міжнародні видання [2, 3].

ТЕМА 2. Методичні основи розроблення та обґрунтування господарських рішень

План лекційного заняття

1. Методи розробки рішень господарської діяльності.
2. Обґрунтування господарських рішень.
3. Методичні основи обґрунтування господарських рішень.
4. Комплексний підхід до обґрунтування господарських рішень.

План лабораторної роботи

1. Аналітичні, статистичні та математичні методи розроблення господарських рішень.
2. Експертні методи та межі їх застосування.
3. Евристичні методи групової та індивідуальної роботи.

План самостійної роботи здобувачів вищої освіти

1. Ділові й організаційно-діяльнісні ігри.
2. Метод сценаріїв.
3. Сутність і види методу «дерева рішень».
4. Види експертних оцінок.
5. Нормативний і дескриптивний підходи до обґрунтування і вибору господарських рішень.
6. Реалізація комплексного підходу до обґрунтування господарських рішень.

Перелік питань для самоконтролю

1. Методи обґрунтування рішень.
2. Сучасні тенденції використання інформаційних технологій у процесі обґрунтування ГР.
3. Обґрунтування й оцінювання варіантів ГР.

4. Система забезпечення реалізації рішень та її формування на підприємстві.
5. Зарубіжний досвід розроблення й обґрунтування ГР.
6. Вплив специфіки підприємства на розроблення й обґрунтування ГР.
7. Особливості розроблення та обґрунтування ГР на малих підприємствах.
8. Вимоги до методів, що використовуються під час обґрунтування ГР.

Рекомендована література:

- основна [3-5];
допоміжна [4, 7];
інформаційні ресурси Інтернет [1, 3];
міжнародні видання [1, 6].

ТЕМА 3. Прогнозування та аналіз господарських рішень

План лекційного заняття

1. Завдання і принципи аналізу господарських рішень.
2. Основні методи прогнозування господарських рішень.
3. Методи аналізу господарських рішень та їхній інструментарій
4. Економічне обґрунтування галузевого розміщення виробництва.

План лабораторної роботи

1. Сформувати транспортну матрицю для двох етапної моделі розвитку і розміщення виробництва.
2. Застосувати метод блокування клітин для пошуку оптимальної стратегії.
3. Знайти оптимальний план розміщення виробництва з використанням табличного процесора Microsoft Excel.
4. Провести аналіз отриманого плану.

План самостійної роботи здобувачів вищої освіти

1. Індексний метод.
2. Метод ланцюгових підстановок.
3. Функціонально-вартісний аналіз.
4. Моделі теорії масового обслуговування.
5. Системний аналіз та сфера його застосування.
6. Багатокритеріальні завдання вибору рішень.

Перелік питань для самоконтролю

1. Сучасні підходи до обґрунтування господарських рішень.
2. Фінансування реалізації ГР. Джерела фінансування господарських рішень та їх оптимізація.
3. Математичні методи аналізу господарських рішень.
4. Методи дослідження операцій.
5. Системний аналіз та сфера його застосування.
6. Основні методи прогнозування ГР.

Рекомендована література:

- основна [3-5];
допоміжна [4, 7];
інформаційні ресурси Інтернет [1, 3];
міжнародні видання [1, 6].

ТЕМА 4. Прийняття рішень в умовах невизначеності

План лекційного заняття

1. Особливості функціонування підприємств за умов невизначеності.
2. Сутність та види невизначеності.
3. Критерії обґрунтування господарських рішень в умовах невизначеності.
4. Матриця прибутків і витрат.

План лабораторної роботи

1. Записати умову математичної моделі задачі в Microsoft Excel.
2. Визначити оптимальну стратегію за критерієм Вальда.
3. Визначити оптимальну стратегію за критерієм мінімального ризику Севіджа.
4. Визначити оптимальну стратегію за критерієм Байєса. Зробити висновки.

План індивідуально-консультаційної роботи

1. Визначення математичного сподівання.
2. Розрахунок коефіцієнтів ризику.

План самостійної роботи здобувачів вищої освіти

Проблема невизначеності в межах сучасної економічної теорії.

2. Статистична та нестатистична невизначеність.
3. Оптимальність за Парето.
4. Змістова характеристика критеріїв Лапласа, Вальда, Севіджа, Гурвіца та особливості їх використання.
5. Напрями зниження невизначеності в господарській діяльності підприємства.

Перелік питань для самоконтролю

1. Невизначеність, ризик, непередбачуваність.
2. Статистична та нестатистична невизначеність.
3. Основні причини невизначеності.
4. Змістова характеристика критеріїв Вальда, Севіджа, Гурвіца та особливості їх використання.
5. Напрями зниження невизначеності в господарській діяльності підприємства.

Рекомендована література:

- основна [4,5];
допоміжна [2, 6];
інформаційні ресурси Інтернет [2, 7];
міжнародні видання [4, 5].

ТЕМА 5. Застосування теорії корисності в процесах прийняття рішень

План лекційного заняття

1. Теорія корисності в системі процесів прийняття рішень.
2. Умови схильності, несхильності та байдужості особи до ризику.
3. Лотерея, її детермінований еквівалент.
4. Методика побудови функції корисності.

План лабораторної роботи

1. Розрахувати власну функцію корисності на основі принципу байдужості вибору в Microsoft Excel.
2. Побудувати графік залежності власної корисності від прибутку в Microsoft Excel.
3. Зробити висновки відносно власної схильності та несхильності до ризику.

План індивідуально-консультаційної роботи

1. Метод порівняння.
2. Балансові моделі
3. Факторні моделі.
4. Моделі управління запасами.

План самостійної роботи здобувачів вищої освіти

1. Вплив політичних та соціально-адміністративних ризиків на поведінку суб'єктів господарювання.
2. Ризики зовнішньоекономічної діяльності
3. Відмінність теорії ігор від реальних конфліктних ситуацій.
4. Приклади відомих проявів податкових ризиків в Україні.
5. Приклади проявів екологічних ризиків на рівні підприємства, регіону, держави, у світовому масштабі.
6. Графоаналітичний спосіб пошуку оптимального рішення за конфліктної ситуації.

Перелік питань для самоконтролю

1. Корисність, функція корисності.
2. Сподівана корисність.
3. Премія за ризик у лотереї.
4. Страхова сума у лотереї.
5. Графіки функцій корисності.
6. Визначення корисності господарських рішень графічним методом.

Рекомендована література:

основна [3-5];
допоміжна [4, 7];
інформаційні ресурси Інтернет [1, 3];
міжнародні видання [1, 6].

ТЕМА 6. Вплив підприємницьких ризиків на прийняття господарських рішень

План лекційного заняття

1. Ризик у діяльності суб'єкта господарювання.
2. Сутнісна характеристика ризику.
3. Ризик як економічна категорія.
4. Ризик і невизначеність.
5. Основні риси підприємницького ризику.
6. Фактори впливу на ступінь підприємницького ризику.

План лабораторної роботи

1. Функції ризику в підприємницькій діяльності.
2. Класифікація підприємницьких ризиків.
3. Прийняття рішень в умовах ризику (приклад).

План самостійної роботи здобувачів вищої освіти

1. Адміністративно-законодавчі ризики.
2. Виробничі ризики.
3. Політичний ризик.
4. Реалізаційні (маркетингові, комерційні) ризики.
5. Фінансові ризики.
6. Крайні ризики (ризики економічної діяльності в окремій країні).
7. Прояви галузевих ризиків (приклад).

Перелік питань для самоконтролю

1. Адміністративно-законодавчі ризики.
2. Виробничі ризики.
3. Політичний ризик.
4. Реалізаційні (маркетингові, комерційні) ризики.
5. Фінансові ризики.
6. Крайні ризики (ризики економічної діяльності в окремій країні).
7. Прояви галузевих ризиків.

Рекомендована література:

основна [3-5];
допоміжна [4, 7];
інформаційні ресурси Інтернет [1, 3];
міжнародні видання [1, 6].

Змістовий модуль 2. Ризик та невизначеність в обґрунтуванні господарських рішень

ТЕМА 7. Критерії прийняття господарських рішень за умов ризику

План лекційного заняття

1. Обґрунтування господарських рішень в умовах ризику.
2. Критерії прийняття рішень за умов ризику.
3. Прийняття рішень в умовах ризику.

План лабораторної роботи

1. Зміст критеріїв Байєса та Ходжеса-Лемана (приклад) .
2. Визначення оптимальної стратегії в умовах ризику (приклад).
3. Використання теорії ігор у практиці управління.

План самостійної роботи здобувачів вищої освіти

1. Класична теорія ризику.
2. Неокласична теорія ризику.
3. Умови існування ризику.
4. Рисі ризику.
5. Залежність прибутку від рівня ризику.
6. Внутрішні фактори ризику управлінської діяльності.

Перелік питань для самоконтролю

1. Сподівана корисність.
2. Премія за ризик у лотереї.
3. Страхова сума у лотереї.
4. Графіки функцій корисності.
5. Визначення корисності господарських рішень графічним методом.

Рекомендована література:

- основна [1-5];
допоміжна [2, 5];
інформаційні ресурси Інтернет [2, 3];
міжнародні видання [1, 4].

ТЕМА 8. Прийняття рішень у конфліктних ситуаціях

План лекційного заняття

1. Аналіз конфліктних ситуацій з використанням теорії ігор.
2. Стратегічні ігри та ігри з природою.
3. Статистичні ігри.
4. Прийняття рішень в умовах повної невизначеності.
5. Чиста та змішана стратегії.

План лабораторної роботи

1. Сформувані платіжну матрицю стратегічної гри довільного розміру.
2. Визначити наявність сідлової точки(при наявності сідлової точки задача розв'язана, в іншому випадку – перейти до пункту 3).
3. Розв'язати задачу в змішаних стратегіях з використанням табличного процесора Microsoft Excel з вбудованим оптимізаційним модулем “Пошук рішення” (“Solver”):
 - визначити структуру моделі на робочому листі;
 - визначити блок стартових значень змінних допоміжної задачі;
 - ввести обмеження задачі;
 - ввести цільову функцію;
 - визначити діапазон змінних задачі;
 - ввести обмеження на невід’ємність змінних;
 - знайти оптимальну стратегію.

План самостійної роботи здобувачів вищої освіти

1. Гра з нульовою сумою. Антагоністична гра.
2. Алгоритм розв'язку стратегічної гри.
3. Виявлення збиткової стратегії за виглядом платіжної матриці.
4. Перевірка платіжної матриці на наявність сідлової точки.
5. Пошук оптимального рішення гри.

Перелік питань для самоконтролю

1. Вплив політичних та соціально-адміністративних ризиків на поведінку суб'єктів господарювання.
2. Ризики зовнішньоекономічної діяльності
3. Відмінність теорії ігор від реальних конфліктних ситуацій.
4. Приклади відомих проявів податкових ризиків в Україні.
5. Приклади проявів екологічних ризиків на рівні підприємства, регіону, держави, у світовому масштабі.
6. Графоаналітичний спосіб пошуку оптимального рішення за конфліктної ситуації.

Рекомендована література:

- основна [3-5];
допоміжна [4, 7];
інформаційні ресурси Інтернет [1, 3];
міжнародні видання [1, 6].

ТЕМА 9. Обґрунтування фінансових та інвестиційних рішень за умов ризику

План лекційного заняття

1. Інвестиційні рішення та критерій ефективності їх прийняття.

2. Критерії обґрунтування рішень під час вибору та прийняття інвестиційного проекту.
3. Сутність фінансових рішень. Портфелі Г. Марковіца і Р. Гобіна.
4. Теорія оптимального портфеля. Формування оптимального портфеля з обмеженої кількості цінних паперів.

План лабораторної роботи

1. Сформуувати матрицю динаміки курсу акцій емітентів за 12-місяців.
2. Побудувати графік динаміки курсу акцій емітентів.
3. Обчислити динаміку дохідності акцій емітентів за періодами та середню дохідність.
4. Обчислити коваріаційну матрицю для рядів, у яких наведено дохідність відповідних акцій.
5. Сформуувати коваріаційну матрицю дохідності цінних паперів.
6. Побудувати модель Марковіца в явній формі.
7. Знайти числовий роз'язок моделі Марковіца.
8. Зробити висновки.

План самостійної роботи здобувачів вищої освіти

1. Врахування ризику при обґрунтуванні ставки дисконтування. Коефіцієнт систематичного ризику.
2. Опціонний критерій прийняття рішень.
3. Систематичний ризик і очікувана дохідність компанії.
4. Проектний ризик і прийняття інвестиційних рішень.
5. Прийняття фінансових рішень за умов ризику.

Перелік питань для самоконтролю

1. Чинники ризику, що враховуються під час оцінювання коефіцієнта β .
2. Метод кумулятивної побудови ставки дисконту.
3. Використання теорії опціонів для оцінювання ризикових інвестицій.
4. Врахування крайніх ризиків під час оцінювання інвестиційних проектів.
5. Оцінка стабільності роботи підприємства порівняно з ефективністю роботи галузі в цілому.
6. Порівняльний аналіз ступеня ризику інвестиційних проектів.

Рекомендована література:

- основна [1-5];
допоміжна [4, 7];
інформаційні ресурси Інтернет [1, 3];
міжнародні видання [1, 6].

ТЕМА 10. Якісне та кількісне оцінювання підприємницьких ризиків

План лекційного заняття

1. Системний підхід до аналізу ризику підприємства.
2. Якісний аналіз підприємницьких ризиків. Характеристика основних зон ризику.
3. Оцінювання ступеня політичного ризику за методикою Всесвітнього банку.
4. Соціальні ризики як наслідок соціального напруження.
5. Врахування податкових ризиків в підприємницькій діяльності.
6. Якісний аналіз виробничих, комерційних, фінансових ризиків.

План лабораторної роботи

1. Побудувати модель ризику цінних паперів та її графік в програмі Gretl.
2. Оцінка якості побудованої моделі.
3. Оцінка прогнозів для заданих значень незалежних змінних. Зробити висновки.

План індивідуально-консультаційної роботи

1. Ризик цінних паперів у відносному вираженні. Кореляція цінних паперів та її застосування.

2. Спрощена класична модель формування портфеля (модель Шарпа).

План самостійної роботи здобувачів вищої освіти

1. Переваги й недоліки основних методів кількісного оцінювання підприємницьких ризиків.
2. Переваги й недоліки методів кількісного оцінювання ризику інвестиційних проектів.
3. Аналіз варіабельності прибутку.
4. Застосування пакетів прикладних програм для кількісного аналізу підприємницьких ризиків.

Перелік питань для самоконтролю

1. Системи вимірювання ринкових ризиків: сутність і межі застосування.
2. Ризики стратегії.
3. Ризики постачання та причини їх виникнення.
4. Реалізаційні (маркетингові, комерційні) ризики.
5. Групи транспортних ризиків.
6. Ризики непередбаченої конкуренції.
7. Ризики ЗЕД.
8. Ризики НДДКР (технічні ризики).

Рекомендована література:

основна [3-5];
допоміжна [4, 7];
інформаційні ресурси Інтернет [1, 3];
міжнародні видання [1, 6].

ТЕМА 11. Основи ризик-менеджменту

План лекційного заняття

1. Сутність і структурна схема ризик-менеджменту.
2. Функції керованої та керуючої підсистем управління ризиками.
3. Управління підприємницькими ризиками.
4. Процес управління ризиками господарської діяльності на підприємстві та характеристика його етапів.

План лабораторної роботи

1. Побудова моделі однопродуктової задачі і розв'язати використовуючи табличний процесор MS Excel.
2. Побудова моделі багатопродуктової задачі і розв'язати використовуючи табличний процесор MS Excel.
3. Побудова графіка отриманої моделі. Зробити висновки.

План самостійної роботи здобувачів вищої освіти

1. Основні функції керованої та керуючої підсистем ризик-менеджменту.
2. Спрямованість діяльності відділу з ризик-менеджменту.
3. Основні етапи управління ризиком.

Перелік питань для самоконтролю

1. Вибір методів впливу на ступінь ризику.
2. Формування комплексної системи ризик-менеджменту на підприємствах.
3. Сутність несистемних ризиків та можливості зведення їх до мінімуму.
4. Оцінювання ефективності системи ризик-менеджменту.
5. Правове забезпечення розв'язання проблеми ризикології.

Рекомендована література:

основна [3-5];
допоміжна [4, 7];
інформаційні ресурси Інтернет [1, 3];
міжнародні видання [1, 6].

ТЕМА 12. Напрями і методи регулювання та зниження ступеня ризику

План лекційного заняття

1. Основні напрями й методи впливу на ступінь ризику господарювання.
2. Уникнення та компенсація ризику.
3. Збереження та передавання ризику.
4. Хеджування та страхування ризиків.

План лабораторної роботи

1. Побудова моделі багатопродуктової задачі і розв'язати використовуючи табличний процесор MS Excel.
2. Побудова графіка отриманої моделі. Зробити висновки.

План самостійної роботи здобувачів вищої освіти

1. Методи зниження ступеня ризику.

2. Характеристика диверсифікації діяльності підприємства.
3. Модуль «імовірність виникнення втрат/рівень збитків».
4. Пошук рішення щодо оптимізації ступеня ризику.

Перелік питань для самоконтролю

1. Сучасні напрями та методи оптимізації ступеня ризиків господарської діяльності, оцінювання їх ефективності.
2. Світовий досвід регулювання ступеня підприємницьких ризиків.
3. Вплив виробничих ризиків на діяльність підприємства та напрями їх регулювання.
4. Вплив фінансових ризиків на діяльність підприємства та напрями їх регулювання.
5. Вплив комерційних ризиків на діяльність підприємства та напрями їх регулювання.
6. Сутність та види диверсифікації, її переваги і недоліки.
7. Проблеми і перспективи впровадження ризик-менеджменту на вітчизняних підприємствах.

Рекомендована література:

- основна [3-5];
 допоміжна [4, 7];
 інформаційні ресурси Інтернет [1, 3];
 міжнародні видання [1, 6].

4. КРИТЕРІЇ ОЦІНЮВАННЯ

Критерієм успішного проходження здобувачем освіти підсумкового оцінювання може бути досягнення ним мінімальних порогових рівнів оцінок за кожним запланованим результатом навчання навчальної дисципліни.

Максимальна кількість балів отримана здобувачем вищої освіти на практичному занятті становить 2,0 бали.

Виконання самостійної роботи, як правило, оцінюється під час проведення лабораторного заняття у вигляді опитування у тому числі за питаннями, які виносяться на самостійну роботу.

Максимальну кількість балів, яку здобувач вищої освіти може отримати за поточну успішність складає 50 балів і заліку – 50 балів.

Загальний розподіл балів, які здобувач вищої освіти може отримати в межах 100-бальної системи оцінювання, повинен включати обов'язкове комп'ютерне тестування на платформі дистанційного навчання ДПУ MOODLE (максимально до 5 балів).

Розподіл балів з навчальної дисципліни «Ризикологія» :

Денна форма навчання

Модулі	Модуль 1 – (44 бали)						Диференційований залік	Загальна оцінка з курсу
Заг. кількість балів за модулем № 1	ЗМ 1 – 28 балів						Контрольний захід № 1	100
Теми	T.1	T.2	T.3	T.4	T.5	T.6	16	
Відповідь на лабораторному занятті			4	4	4	4		
Самостійна робота	2	2	2	2	2	2		
Модулі	Модуль 2 – (51 бали)							
Заг. кількість балів за модулем № 1	ЗМ 2 – 35 балів						Контрольний захід № 2	
Теми	T.7	T.8	T.9	T.10	T.11	T.12	16	
Відповідь на лабораторному занятті	2	4	2	2	4	2		
Самостійна робота	2	2	2	2	2	2		
Індивідуальна робота	7							
Підсумковий тестовий контроль на платформі дистанційного навчання	5							

ДПУ MOODLE										
Заочна форма навчання										
Модулі	Модуль 1 – (44 бали)						Диференційований залік	Загальна оцінка з курсу		
Заг. кількість балів за модулем № 1	ЗМ 1 – 28 балів					Контрольний захід № 1	ЗМ1+3 М2+ MOODLE =44+51 +5	100		
Теми	T.1	T.2	T.3	T.4	T.5	T.6			16	
Відповідь на лабораторному занятті					4					
Самостійна робота	4	4	4	4	4	4				
Модулі	Модуль 2 – (51 балів)									
Заг. кількість балів за модулем № 1	ЗМ 2 – 35 балів					Контрольний захід № 2				
Теми	T.7	T.8	T.9	T.10	T.11	T.12			16	
Відповідь на лабораторному занятті			4							
Самостійна робота	4	4	4	4	4	4				
Індивідуальна робота	7									
Підсумковий тестовий контроль на платформі дистанційного навчання ДПУ MOODLE	5									

Оцінювання роботи студентів на лабораторних заняттях. Протягом восьми лабораторних занять студент може отримати від 0 до 4 балів за знання методики побудови аналітичних моделей і проведення поетапного аналізу результатів моделювання економічних процесів. Вісім лабораторних робіт виконуються по індивідуальним завданням із використанням прикладних програм, ПК, інтернет ресурсів і оцінюються від 0 до 32 балів.

Критерії оцінювання лабораторних занять подано нижче:

Максимальна кількість балів 4 з них:	
4 бали	Вірна побудова аналітичної моделі. Повне інформаційне забезпечення вирішуваного завдання, а саме: визначення необхідної інформації, методики її отримання, збору, аналізу і попередньої обробки перед застосуванням при моделюванні. Детальний аналіз отриманого рішення і висновки, розкриття змістовної відповіді на усі пункти дослідження. Виклад матеріалу логічний, послідовний, лаконічний. Проявлено вміння аналізувати-узагальнювати-порівнювати.
2 бали	Вірна побудова аналітичної моделі. Інформаційне забезпечення вирішуваного завдання. Аналіз отриманого рішення і висновки. Механічність, фрагментарність пояснень. Порушення логіки та послідовності викладення матеріалу.
1 бал	Невірна побудова аналітичної моделі. Інформаційне забезпечення вирішуваного завдання. Аналіз отриманого рішення і висновки. Механічність, фрагментарність пояснень. Порушення логіки та послідовності викладення матеріалу, недостатня самостійність мислення.
0	Повна відсутність виконання завдань.

Критерії оцінювання контрольних робіт.

Формою проміжного поточного контролю є контрольні роботи, які проводяться у письмовій формі та кожна з яких оцінюється від 0 до 16 балів.

Розподіл балів за різними видами завдань в межах контрольної роботи

Вид завдання	Максимальна кількість балів за виконання
Теоретичні питання	6
Задачі	10
Всього	16

Критерій оцінювання відповіді на теоретичне питання (розробляється відповідно до специфіки дисципліни)

Критерії оцінювання	Кількість балів
Оцінюється робота здобувача вищої освіти, який в повному обсязі дав відповіді на всі питання. При цьому використовував актуальну наукову термінологію, належним чином обґрунтовував свої думки та зробив узагальнені підсумки.	6
Оцінюється робота здобувача вищої освіти, який в основному розкрив зміст теоретичних питань. Проте, при висвітленні деяких питань не вистачало достатньої аргументації. Допускались при цьому окремі неточності та незначні помилки.	4
Оцінюється робота здобувача вищої освіти, який дав фрагментарні відповіді на теоретичні питання (без аргументації й обґрунтування, підсумків), у відповідях присутні неточності та помилки або відповідь дана лише на окремі питання.	2
Оцінюється робота здобувача вищої освіти, який дав неправильну відповідь на всі теоретичні питання, допустив істотні помилки, оперував неактуальною застарілою інформацією або відповіді на питання відсутні взагалі.	0

Критерії оцінювання блоку задачі

Критерії оцінювання	Кількість балів
Правильно вирішив усі задачі	10
Жодної правильної відповіді	0

Критерій оцінювання самостійної роботи.

Самостійна робота здійснюється у формі написання план-конспекту і оцінюється від 0 до 2 балів.

Шкала оцінювання самостійної роботи здобувачів вищої освіти

Кількість балів		Критерії оцінювання
денна	заочна	
1,5-2	3-4	Послідовність логічність написання план-конспекту, а також підготовка презентації та відповідно, його захист, а також виокремлення з різних джерел основних положень, які структурно об'єднані, проаналізовані та узагальнені висновками
0,5-1	1-2	Послідовність, логічність написання план-конспекту, але без презентації
0	0	Не написано план-конспект та не зроблено презентацію по ньому

Критерій оцінювання індивідуальної роботи.

Індивідуальна робота здійснюється у формі реферату, проекту і оцінюється від 0-до 7 балів.

Шкала оцінювання індивідуальної роботи здобувачів вищої освіти

Кількість балів	Критерії оцінювання
7	Послідовність логічність написання реферату, а також підготовка презентації та відповідно, його захист, а також виокремлення з різних джерел основних положень, які структурно об'єднані, проаналізовані та узагальнені висновками
4	Послідовність, логічність написання реферату, але без презентації
0	Не написано реферат та не зроблено презентацію по ньому

Здобувач вищої освіти, який за результатами відповіді на лабораторних заняттях, перевірки виконання самостійної роботи, написання контрольної роботи отримав менше 25 балів до складання диференційованого заліку не допускається.

Таблиця відповідності результатів контролю знань за різними шкалами й критеріями оцінювання Переведення даних 100-бальної шкали оцінювання в національну шкалу та шкалу за системою ЄКТС здійснюється в такому порядку:

Таблиця відповідності результатів контролю знань за різними шкалами й критеріями оцінювання

Переведення даних 100-бальної шкали оцінювання в національну шкалу та шкалу за системою ЄКТС здійснюється в такому порядку:

Сума балів за 100-	Оцінка в	Значення оцінки ЄКТС	Критерії оцінювання	Рівень компетентності	Оцінка за національною шкалою
---------------------------	-----------------	-----------------------------	----------------------------	------------------------------	--------------------------------------

бально ю шкало ю	ЄКТ С				Екзамен/ Диферен ційовани й залік	Залік
90-100	A	відмінно	Здобувач вищої освіти виявляє особливі творчі здібності, вміє самостійно здобувати знання, без допомоги викладача знаходить та опрацьовує необхідну інформацію, вміє використовувати набуті знання і вміння для прийняття рішень у нестандартних ситуаціях, переконливо аргументує відповіді, самостійно розкриває власні обдарування і нахили	Високий (творчий)	відмінно	
80-89	B	дуже добре	Здобувач вищої освіти вільно володіє вивченим обсягом матеріалу, застосовує його на практиці, вільно розв'язує вправи і задачі у стандартних ситуаціях, самостійно виправляє допущені помилки, кількість яких незначна			
70-79	C	добре	Здобувач вищої освіти вміє зіставляти, узагальнювати, систематизувати інформацію під керівництвом викладача; в цілому самостійно застосовувати її на практиці; контролювати власну діяльність; виправляти помилки, серед яких є суттєві, добирати аргументи для підтвердження думок	Достатній (конструктив о - варіативний)	добре	зара- ховано
60-69	D	задовільно	Здобувач вищої освіти відтворює значну частину теоретичного матеріалу, виявляє знання і розуміння основних положень; з допомогою викладача може аналізувати навчальний матеріал, виправляти помилки, серед яких є значна кількість суттєвих			
50-59	E	достатньо	Здобувач вищої освіти володіє навчальним матеріалом на рівні, вищому за початковий, значну частину його відтворює на репродуктивному рівні	Середній (репродуктив ний)	Задов.	
35-49	FX	незадовільно з можливістю повторного складання семестрово го контролю	Здобувач вищої освіти володіє матеріалом на рівні окремих фрагментів, що становлять незначну частину навчального матеріалу	Низький (рецептивно- продуктивний)	незадовіл ьно	не зара- ховано
0-34	F	незадовільно з	Здобувач вищої освіти володіє матеріалом на рівні елементарного			

		обов'язковим повторним вивченням залікового кредиту	розпізнання і відтворення окремих фактів, елементів, об'єктів			
--	--	---	---	--	--	--

Переведення даних 100-бальної шкали оцінювання в 4-бальну та шкалу за системою ЄКТС здійснюється в такому порядку (для навчальної дисципліни, що вивчається протягом одного, двох і більше семестрів з підсумковим контролем у формі диференційованого заліку):

Сума балів за 100-бальною шкалою	Оцінка в ЄКТС	Значення оцінки ЄКТС	Рівень компетентності	Оцінка за національною шкалою	
				Екзамен/диференційований залік	залік
90-100	A	відмінно	Високий (творчий)	відмінно	зараховано
80-89	B	дуже добре	Достатній (конструктивно - варіативний)	добре	
70-79	C	добре			
60-69	D	задовільно	Середній (репродуктивний)	задовільно	
50-59	E	достатньо			
35-49	FX	незадовільно з можливістю повторного складання семестрового контролю	Низький (рецептивно-продуктивний)	незадовільно	не зараховано
0-34	F	незадовільно з обов'язковим повторним вивченням залікового кредиту			

Результати складання диференційованого заліку оцінюються за чотирибальною шкалою («відмінно», «добре», «задовільно», «незадовільно») і вносяться у відомість обліку успішності студента, залікову книжку, індивідуальний навчальний план студента (крім «незадовільно» і «не зараховано»).

Критерієм успішного проходження здобувачем освіти підсумкового оцінювання може бути досягнення ним мінімальних порогових рівнів оцінок за кожним запланованим результатом навчання навчальної дисципліни.

Здобувачі, які набрали за семестр з дисципліни (за результатами ПМК) від 35 до 49 балів (оцінка за ЄКТС – FX) мають право на **повторне складання ПМК**. В цьому випадку при ліквідації академічної заборгованості бали, отримані за поточні, модульні контролю та індивідуально-самостійну роботу, не враховуються. Нова оцінка складається як сумарна кількість балів, одержана за написання письмової залікової роботи (max =100).

Академічна заборгованість вважається ліквідованою, якщо студент набрав у сукупності не менше 50 балів.

5. ЗАСОБИ ОЦІНЮВАННЯ

Засобами оцінювання та методами демонстрування результатів навчання:

- диференційований залік;
- стандартизовані тести;
- аналітичні звіти, реферати, есе;
- розрахункові та розрахунково-графічні роботи;
- презентації результатів виконаних завдань та досліджень;
- студентські презентації та виступи на наукових заходах;
- розрахункові роботи;
- завдання на лабораторному обладнанні, тренажерах, реальних об'єктах;
- інші види індивідуальних та групових завдань.

- комп'ютерне тестування на платформі Moodle.

6. ФОРМИ ТА ПЕРЕЛІК ПИТАНЬ ДО ПОТОЧНОГО ТА ПІДСУМКОВОГО КОНТРОЛЮ

Оцінювання знань студентів здійснюється на основі усних і письмових відповідей на практичних заняттях, тестів, практичних робіт, ситуаційних завдань, кейсів, ділових ігор, письмових контрольних заходів, індивідуально-консультативної роботи, виконання завдань у системі дистанційної освіти Moodle.

Перелік питань до поточного контролю з курсу «Ризикологія»

1. Об'єкт, предмет, мета, завдання та структура курсу, об'єктивна необхідність застосування теорії економічного ризику.
2. Історія виникнення теорії економічного ризику.
3. Ризик як економічна категорія. Об'єкт, суб'єкт, джерело ризику.
4. Концептуальні засади й аксіоматика ризикології.
5. Невизначеність та ризик.
6. Причини виникнення невизначеності, її види.
7. Основні причини виникнення економічного ризику.
8. Ризик як об'єктивно-суб'єктивна економічна категорія. Класифікація ризику.
9. Структура ризику.
10. Види ризиків залежно від напрямів та сфер діяльності.
11. Ставлення до ризику суб'єктів прийняття рішень.
12. Багатокрокова процедура аналізу ризику.
13. Аналіз чинників ризику.
14. Аналіз чинників невизначеності, конфліктності та породжуваного ними економічного ризику.
15. Причини багатокритеріальності та конфліктності.
16. Статистична та не статистична (суб'єктивна) ймовірність
17. Метод аналогій.
18. Аналіз чутливості (вразливості).
19. П'ять спрощених ситуацій прийняття рішення.
20. Аналіз ризику можливих збитків
21. Зони ризику збитків, допустимі, критичні та катастрофічні зони збитків і ризику.
22. Функція щільності розподілу ймовірності збитків.
23. Наслідки кількісного аналізу ризику.
24. Загальні підходи щодо кількісної оцінки ступеня ризику.
25. Ризик в абсолютному вираженні.
26. Ризик у відносному вираженні.
27. Ризик та нерівність Чебишева.
28. Визначення меж зон допустимого, критичного та катастрофічного ризиків
29. Коефіцієнт чутливості та його використання в економіці.

Перелік питань підсумкового контролю навчальної дисципліни

1. Об'єкт, предмет, мета, завдання та структура курсу, об'єктивна необхідність застосування теорії економічного ризику.
2. Історія виникнення теорії економічного ризику.
3. Ризик як економічна категорія. Об'єкт, суб'єкт, джерело ризику.
4. Концептуальні засади й аксіоматика ризикології.
5. Невизначеність та ризик.
6. Причини виникнення невизначеності, її види.
7. Основні причини виникнення економічного ризику.
8. Ризик як об'єктивно-суб'єктивна економічна категорія. Класифікація ризику.
9. Структура ризику.
10. Види ризиків залежно від напрямів та сфер діяльності.
11. Ставлення до ризику суб'єктів прийняття рішень.
12. Багатокрокова процедура аналізу ризику.
13. Аналіз чинників ризику.
14. Аналіз чинників невизначеності, конфліктності та породжуваного ними економічного

ризик.

15. Причини багатокритеріальності та конфліктності.
16. Статистична та не статистична (суб'єктивна) ймовірність
17. Метод аналогій.
18. Аналіз чутливості (вразливості).
19. П'ять спрощених ситуацій прийняття рішення.
20. Аналіз ризику можливих збитків
21. Зони ризику збитків, допустимі, критичні та катастрофічні зони збитків і ризику.
22. Функція щільності розподілу ймовірності збитків.
23. Наслідки кількісного аналізу ризику.
24. Загальні підходи щодо кількісної оцінки ступеня ризику.
25. Ризик в абсолютному вираженні.
26. Ризик у відносному вираженні.
27. Ризик та нерівність Чебишева.
28. Визначення меж зон допустимого, критичного та катастрофічного ризиків
29. Коефіцієнт чутливості та його використання в економіці.
30. Концепція теорії корисності.
31. Пріоритети та їх числове відображення.
32. Приклади функції корисності управлінської команди (особи), яка приймає рішення,

обтяжене ризиком.

33. Корисність за Нейманом.
34. Поняття лотереї Сподівана корисність. Детермінований еквівалент лотереї. Страхова сума, премія за ризик.

сума, премія за ризик.

35. Різні ставлення до ризику, схильність-несхильність до ризику та функція корисності.
36. Криві байдужості. Криві схильності-несхильності до ризику.
37. Побудова функції корисності.
38. Теоретико-ігрова модель, концепція теорії гри.
39. Економічне середовище Функціонал оцінювання. Функція ризику. Матриця ризику.
40. Інформаційна ситуація. Прийняття рішень в умовах ризику.
41. Критерії прийняття рішень.
42. Критерій Парето.
43. Специфіка оптимального планування в умовах невизначеності.
44. Задачі стохастичного програмування, цільові функції яких є функціями ризику.
45. Моделі прийняття рішень в умовах ризику, подані двома взаємопов'язаними блоками.
46. Моделювання економічного ризику та двохетапні моделі стохастичної оптимізації.
47. Поняття якісних та бінарних величин. Моделі бінарного вибору.
48. Логіт-модель та її побудова. Показники якості та тестування моделі.
49. Пробіт-модель та метод її побудови. Показники якості та тестування моделі.
50. Концепція управління ризиком у спектрі економічних проблем.
51. Узагальнена блок-схема процесу управління ризиком.
52. Зовнішні способи зниження ступеня ризику.
53. Внутрішні способи зниження (оптимізації) ступеня ризику.
54. Доцільність обрання певної комбінації (суперпозиції) методів зниження ступеня

ризик та концепція побудови таблиць рішень.

55. Суть диверсифікації.
56. Суть управління портфелем цінних паперів.
57. Ризик портфеля цінних паперів.
58. Норма прибутку цінних паперів. Сподівана норма прибутку цінних паперів.
59. Ризик цінних паперів в абсолютному вираженні.
60. Ризик цінних паперів у відносному вираженні.
61. Кореляція цінних паперів та її застосування.
62. Портфель цінних паперів. Однорідний портфель цінних паперів.
63. Портфель з двох видів цінних паперів.
64. Портфель з багатьох видів цінних паперів.
65. Оптимізація структури портфеля.
66. Включення в портфель безризикових цінних паперів.

67. Коефіцієнт чутливості.
68. Спрощена класична модель формування портфеля (модель Шарпа).
69. Тактика фінансового менеджера.
70. Структура та види резервів і запасів на непередбачувані витрати.
71. Види матеріальних запасів.
72. Обсяг резерву сировини.
73. Резервування грошових засобів на покриття випадкових затрат.
74. Управління запасами з урахуванням ризику.
75. Модель М. Міллера і Д. Орра. Модель формування оптимального резерву.
76. Задачі управління виробництвом та резервами.
77. Загальна ієрархічна модель прийняття рішень.
78. Формалізовані та неформалізовані етапи процесу побудови моделей багатоцільових задач прийняття рішень.
79. Формування набору критеріїв, розробка шкал їх оцінювання. Нормалізація.
80. Система пріоритетів прийняття рішення.
81. Методи згортки інформації.
82. Ієрархічні моделі прийняття багатоцільових і багатокритеріальних рішень.

7. РЕКОМЕНДОВАНА ЛІТЕРАТУРА

7.1. Основна

1. Полінкевич О. М., Волинець І. Г. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання ризиків : навч. посіб. Луцьк : Вежа-Друк, 2018. 336 с. URL: <http://evnuir.vnu.edu.ua/handle/123456789/15846>
2. Гранатуров В. М. Підприємницький ризик. Ризикологія: методичні вказівки для самостійного вивчення дисциплін. Одеса: ОНАЗ ім. О.С. Попова, 2018. 28 с.
3. Кігель В. Р. Ризикологія: теоретичні основи та прикладні задачі, моделі і методи: навч. посіб. для студентів економічних спеціальностей. К.: Міленіум, 2017. 230 с.
4. Стешенко О. Д. Ризикологія: навчальний посібник. Харків: УкрДУЗТ, 2019. 180 с. URL: <http://lib.kart.edu.ua/handle/123456789/2224>
5. Григорків В.С. Моделювання економіки: підручник. Чернівці : Чернівецький нац. ун-т ім. Ю. Федьковича, 2019. 360 с.

7.2. Допоміжна

1. Дзюблюк О. В., Прийдун Л. М. Кредитний ризик і ефективність діяльності банку : монографія. Тернопіль : Паляниця В. А., 2015. 295 с.
2. Загурський О. М. Управління ризиками : навч. посіб. Київ : Університет «Україна», 2016. 242 с.
3. Економічний ризик: методи оцінки та управління : навч. посіб. для студентів і викладачів екон. спец. ВНЗ / Держ. ВНЗ "Укр. акад. банк. справи Нац. банку України", Каф. банк. справи ; [уклад. : Т. А. Васильєва та ін.] ; за заг. ред. Т. А. Васильєвої, Я. М. Кривич. Суми : ДВНЗ "УАБС НБУ", 2015. 207 с.
4. Кондрашихін А.Б. Теорія та практика підприємницького ризику : навч. посіб. Київ: ЦНЛ, 2016. 224 с.
5. Моделі та методи оцінювання економічних ризиків у різних функціональних сферах бізнесу : монографія. [Мар'яна Вдовин та ін.]. Львів : АТБ, 2015. 247 с.
6. Моделювання оцінки операційного ризику комерційного банку : монографія / [О. С. Дмитрова та ін.] ; за заг. ред. д-ра техн. наук, проф. С. О. Дмитрова. Суми : [ДВНЗ "УАБС НБУ"], 2010. 264 с.
7. Надрага В. І. Соціальні ризики: сутність, аналіз, можливості впливу [Текст] : монографія. НАН України, Ін-т демографії та соц. дослідж. ім. М. В. Птухи. Київ : Сердюк В. Л., 2015. - 329 с.
8. Ризик-менеджмент у банку: теорія та організація : монографія / О. А. Криклій [та ін.] ; Держ. ВНЗ "Укр. акад. банк. справи Нац. банку України". Суми : Корпункт, 2014. 127 с.

7.3. Інформаційні ресурси Інтернет

1. Офіційний сайт Міністерства фінансів України: <http://www.minfin.gov.ua>

2. Офіційний сайт Міністерства економічного розвитку і торгівлі України:
<http://www.me.kmu.gov.ua>
3. Офіційний сайт Національного банку України: <http://www.bank.gov.ua>
4. Офіційний сайт Державної податкової служби України: <http://www.sta.gov.ua>
5. Офіційний сайт Державної служби статистики України: <http://www.ukrstat.gov.ua>
6. Офіційний сайт Державної казначейської служби України: <http://www.treasury.gov.ua>
7. Офіційний сайт Національної комісії з регулювання ринків фінансових послуг України:
<http://www.dfp.gov.ua>
8. Офіційний сайт Державної комісії з цінних паперів та фондового ринку України:
<http://www.ssmc.gov.ua>

7.4. Міжнародні видання

1. Trade in goods, by main world traders – [tet00018]; Imports in million of ECU/EURO URL:
<http://epp.eurostat.ec.europa.eu/tgm/refreshTableAction.do;jsessionid=9ea7974b30dde75c3b71759b4127ba9df9bb4e3fbc01.e34SbxiPb3uSb40Lb34LaxqRb30Ne0?tab=table&plugin=1&pcode=tet00018&language=en>
2. Current Market Outlook 2010-2030. Chicago, USA: Boeing corporation, 2012 [Electronic resource]. Mode of access: <http://www.boeing.com>.
3. ICAO Strategic Objectives 2014-2016 [Electronic resource]. Mode of access:
<http://www.icao.int/abouticao/Pages/Strategic>.
4. Global Market Forecast 2011-2050. France: Airbus, 2011 [Electronic resource]. Mode of access: <http://www.airbus.com>.
5. David Ruppert. Statistic sand finance. Springer-Verlag New York LLC. 2014. 476 p.