



Силабус освітнього компонента

Програма навчальної дисципліни

Ризикологія

Шифр та назва спеціальності

Інститут

Навчально-науковий інститут економіки, менеджменту та міжнародного бізнесу

Спеціалізація

Кафедра

Менеджменту (204)

Освітня програма

Тип дисципліни

вибіркова

Рівень освіти

Перший (бакалаврський)

Форма навчання

Денна

Семестр

6

Мова викладання

Українська

Викладачі, розробники



Митрофанова Анастасія Сергіївна

Anastasiia.Mytrofanova@khti.edu.ua

Кандидат економічних наук, доцент, доцент кафедри менеджменту НТУ «ХПІ»

Авторка та співавторка понад 60 наукових і навчально-методичних публікацій. Викладає курси: Управління проектами, Основи проектного менеджменту, SMM-менеджмент (українською та англійською мовами). Детальніше про викладача на сайті кафедри:

<https://web.kpi.kharkov.ua/mto/about/staff/mytrofanova/>

Загальна інформація

Анотація

Дисципліна спрямована на опанування теоретико-практичними принципами і методами управління ризиками, що виникають в процесі господарської діяльності підприємства.

Мета та цілі дисципліни

Розкрити поняття невизначеності і ризику, фактори та класифікація ризику, загальні принципи аналізу ризику, способи зниження ризику, методика оцінки рівня економічної безпеки підприємства, методи урахування ризику проектів та прикладні основи урахування ризику інновацій. Вміти класифікувати ризик, проводити аналіз та давати оцінку ризику, застосовувати різні способи зниження ризику, ураховувати ризик при прийнятті управлінських рішень.

Формат занять

Лекції, практичні заняття, самостійна робота, консультації, реферат. Підсумковий контроль - залік.

Компетентності

ЗК03. Здатність до абстрактного мислення, аналізу, синтезу.

ЗК04. Здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях.

СК07. Здатність обирати та використовувати сучасний інструментарій менеджменту.

Результати навчання

ПРО4. Демонструвати навички виявлення проблем та обґрунтування управлінських рішень.

ПРО16. Демонструвати навички самостійної роботи, гнучкого мислення, відкритості до нових знань, бути критичним і самокритичним.

Обсяг дисципліни

Загальний обсяг дисципліни 120 год. (4кредити ECTS): лекції – 24 год., практичні заняття – 24 год., самостійна робота – 72 год.

Передумови вивчення дисципліни (пререквізити)

Для успішного вивчення курсу необхідно мати знання та практичні навички з наступних дисциплін: "Теорія організації", "Основи менеджменту", "Економіка підприємства".

Особливості дисципліни, методи та технології навчання

Методи та технології навчання передбачають інтерактивні лекції з використанням презентацій. Для проведення семінарів використовуються такі інструменти: аналіз проблемних питань, виконання економічних вправ, розв'язання тестів та їх обговорення, проєктна і командна робота, реєг-to-реєг, презентація та обговорення доповідей. Також застосовуються кейс-метод, проблемне навчання, робота в малих групах.

Програма навчальної дисципліни

Навчальні заняття

Лекції

Теми лекцій	Кількість годин
Тема 1. Теоретичні основи ризику та невизначеності Філософські та методологічні основи ризикології як науки. Концептуальні підходи до визначення ризику та невизначеності. Еволюція наукових поглядів на природу ризику. Системний підхід до дослідження ризикових явищ.	2
Тема 2. Системний аналіз ризику в економіці та підприємстві Властивості, чинники, класифікація ризиків.	2
Тема 3. Методи оцінки та вимірювання ризиків. Якісний аналіз ризиків. Методи обробки експертної інформації.	2
Тема 4. Методи та інструменти кількісного аналізу ризиків. Метод коригування ставки дисконту, аналіз чутливості критеріїв ефективності, метод аналізу сценаріїв, метод Монте-Карло. Інтегровані методи оцінки ризиків. Сучасні цифрові технології в оцінці ризиків.	4
Тема 5. Моделі та стратегії управління ризиками. Класична модель управління ризиками. Портфельна модель Марковіца. Концептуальні моделі управління ризиками. Стратегії реагування на ризики. Інтегровані системи управління ризиками. Динамічні моделі управління ризиками в умовах невизначеності.	4
Тема 6. Врахування ризику при прийнятті управлінських рішень Поняття мети та альтернативи в теорії прийняття управлінських рішень. Класифікація управлінських рішень.	2
Тема 7. Ризики в економічних системах	2

Макроекономічні системні ризики: класифікації, прояви. Поведінкові ризики в економічних системах. Фінансові ризики банківських та небанківських установ. Стратегічні та операційні ризики суб'єктів господарювання.

Тема 8. Ризики сталого розвитку Кліматичні зміни. Невизначеність кліматичної політики. Екосистемні ризики. Соціальні ризики та демографічні виклики. ESG-ризики в корпоративному управлінні. Інтегроване управління ризиками сталого розвитку.	2
Тема 9. Кіберризики та ризики в інформаційних технологіях. Класифікація та характеристика кіберризиків. Інформаційна безпека та захист персональних даних. Ризики цифрової трансформації бізнес-процесів. Ризики штучного інтелекту та автоматизації.	2
Тема 10. Ризики в умовах глобалізації та міжнародної діяльності Геополітичні ризики та міжнародні економічні відносини. Валютні ризики та ризики міжнародних фінансових ринків. Ризики міжнародних ланцюгів постачання.	2
Загальна кількість годин	24

Практичні заняття

Теми практичних/семінарських занять	Кількість годин	Вагові коефіцієнти <i>a</i>
Тема 1. Вступне заняття. Вступ до ризикології. Цілі та завдання курсу. Порядок виконання індивідуального завдання. Система оцінювання.	2	1
Тема 2. Теоретичні основи ризику та невизначеності Ризикологія як наукова дисципліна. Сутність ризику та невизначеності.	2	1
Тема 3. Системний аналіз ризику в економіці та підприємстві Властивості, чинники, класифікація ризиків.		
Тема 4. Методи оцінки та вимірювання ризиків. Якісний аналіз ризиків. Методи обробки експертної інформації.	2	1
Тема 5. Методи та інструменти кількісного аналізу ризиків. Інтегровані методи оцінки ризиків. Сучасні цифрові технології в оцінці ризиків.	4	1
Тема 6. Моделі та стратегії управління ризиками. Класична модель управління ризиками. Портфельна модель Марковіца. Концептуальні моделі управління ризиками. Стратегії реагування на ризики.	4	1
Тема 7. Врахування ризику при прийнятті управлінських рішень Поняття мети та альтернативи в теорії прийняття управлінських рішень.	2	1
Тема 8. Ризики в економічних системах Макроекономічні системні ризики: класифікації, прояви.	2	1
Тема 9. Ризики сталого розвитку Кліматичні зміни. Невизначеність кліматичної політики. Екосистемні ризики.	2	1

Тема 10. Кіберризика та ризики в інформаційних технологіях. Ризики цифрової трансформації бізнес-процесів. Ризики штучного інтелекту та автоматизації.	2	1
Тема 11. Ризики в умовах глобалізації та міжнародної діяльності Геополітичні ризики та міжнародні економічні відносини..	2	1
Загальна кількість годин	24	$\sum_{i=1}^n a_i=10$

Лабораторні заняття

лабораторні заняття не передбачені навчальним планом

Контрольні роботи

Комплексна контрольна робота з основ ризикології		Вагові коефіцієнти b
Тема. Методологія, принципи та практика сучасної ризикології. Питання охоплюють традиційні та сучасні підходи в ризикології. Теоретичні основи ризику та невизначеності. Системний аналіз ризику в економіці. Методи оцінки та вимірювання ризиків. Моделі та стратегії управління ризиками. Врахування ризику при прийнятті управлінських рішень.		1
Загалом		$\sum_{i=1}^m b_i=1$

Самостійна робота

До самостійної роботи відноситься самостійне опрацювання теоретичного матеріалу та виконання індивідуального завдання (реферат).

Опрацювання теоретичного матеріалу

Теми для самостійного вивчення	Кількість годин
Тема 1. Теоретичні основи ризику та невизначеності Історія розвитку ризикології та ризик-менеджменту. Підходи до визначення поняття ризик.	4
Тема 2. Системний аналіз ризику в економіці та підприємстві Особливості сучасного ризику. Характеристика видів ризику. Правовий аспект ризику.	4
Тема 3. Методи оцінки та вимірювання ризиків. Переваги та недоліки різних методів оцінки ризиків. Математичні методи оцінки економічних ризиків	4
Тема 4. Методи та інструменти кількісного аналізу ризиків Кількісні оцінки економічного ризику в умовах невизначеності	4
Тема 5. Моделі та стратегії управління ризиками Резервування коштів на покриття непередбачених витрат 2. Ризик інвестиційних рішень. Ризикові і безризикові активи. Взаємозв'язок ризику і прибутку.	4
Тема 6. Врахування ризику при прийнятті управлінських рішень Класифікація управлінських рішень. Поняття мети та альтернативи в теорії прийняття управлінських рішень.	4
Тема 7. Ризики в економічних системах Фінансові ризики банківських та небанківських установ.	4

Тема 8. Ризики сталого розвитку Міграційні процеси як фактор соціальних ризиків в Україні: виклики та можливості.. Використання аналізу великих даних для прогнозування ризиків сталого розвитку.	4
Тема 9. Кіберризики та ризики в інформаційних технологіях Забезпечення інформаційної безпеки організацій та мінімізації технологічних ризиків у контексті цифрової трансформації бізнес-процесів. Цифрова трансформація в Україні: баланс між інноваціями та ризиками.	4
Тема 10. Ризики в умовах глобалізації та міжнародної діяльності Диверсифікація ланцюгів постачання як інструмент зниження операційних ризиків.. Вплив європейських регуляцій (GDPR, CBAM) на міжнародну діяльність українських компаній. Роль цифрових валют (CBDC) у трансформації міжнародних фінансових ринків.	4
Загальна кількість годин	40

Тематика індивідуальних завдань

Рекомендований обсяг завдання (реферат) - 12 - 15 сторінок. Технічні вимоги до оформлення: шрифт Times New Roman, кегль 14; міжрядковий інтервал - 1,5; абзац - 1,25 см, поля: праве - 15 мм, ліве - 25 мм, верхнє, нижнє - 20 мм. Обов'язкова нумерація сторінок.

Внутрішня структура роботи наступна:

- Титульна сторінка;
- Зміст;
- Вступ (актуальність теми, мета та завдання роботи);
- 1.
- 2....
- Список використаних джерел.
- Додатки (якщо є).

У процесі роботи студенти повинні використовувати не менше 10 якісних релевантних наукових джерел. Всі бібліографічні записи повинні містити відповідне внутрішньотекстове посилання. Завдання виконується протягом навчальних тижнів і подається на перевірку до екзамену

Теми індивідуального завдання

Тема 1. Суспільство ризику та сучасні виклики

Тема 2. Еволюція поглядів на ризик.

Тема 3. Концепція «суспільства ризику» Ульріха Бека та її значення для сучасного менеджменту

Тема 4. Резильєнтність організацій у турбулентному середовищі

Тема 5. Якісні методи аналізу ризиків

Тема 6. Кількісні методи аналізу ризиків

Тема 7. Процес управління ризиками

Тема 8. Інтегрований ризик-менеджмент

Тема 9. Big Data і аналіз ризиків

Тема 10. Штучний інтелект та машинне навчання у аналізі ризиків

Тема 11. Сценарне та імітаційне моделювання як інструменти управління ризиками.

Тема 12. Стратегії реагування на ризики

Тема 13. Операційні ризики в цифровій економіці: виклики та рішення для українських підприємств

Тема 14. Соціальні виклики України в умовах демографічної кризи та війни.

Тема 15. Впровадження ESG-принципів в українському корпоративному секторі

Тема 16. Вплив регуляторних ESG-вимог на інвестиційну привабливість українських компаній.

Тема 17. Кліматичні ризики та їх вплив на економіку України.

Тема 18. Інтегровані системи управління ризиками (COSO ERM, ISO 31000): принципи побудови та їх роль у підвищенні стійкості організації.

Тема 19. Поведінкова економіка як роль когнітивних упереджень у формуванні економічних рішень

Тема 20. Стратегії управління фінансовими ризиками в банківському секторі.

Загальна кількість годин

32

Неформальна освіта

Здобувач вищої освіти має можливість перезарахувати окремі теми або питання курсу шляхом відвідування професійних курсів, тренінгів, онлайн-освіти, професійних стажувань, у сфері, що відповідає навчальним цілям дисципліни.

Для зарахування необхідно надати: сертифікат (електронний або друкований) про проходження курсу/стажування, опис програми тренінгу із зазначенням змісту тем, обсягу та тривалості.

Рекомендовані курси, тренінги, стажування

1. Управління ризиками

<https://ua.educations.com/institutions/alison-free-online-learning/upravlinnya-rizikami-bezkoshtovnij-onlajn-kurs-z-diplomom>

2. ISO 31000:2018 – Структура управління ризиками підприємства для керівників ризиків.

<https://ua.educations.com/institutions/alison-free-online-learning/iso-310002018-struktura-upravlinnya-rizikami-pidpriyemstva-dlya-kerivnikiv-rizikiv-bezkoshtovnij-onlajn-kurs-iz-sertifikatom>

3. Курс управління операційними ризиками

<https://ua.educations.com/institutions/alison-free-online-learning/kurs-upravlinnya-operacijnimi-rizikami>

Література, навчальні матеріали та інформаційні ресурси

Основна література

1. Мороз, В. М. (2019). Ризик-менеджмент : навч. посібник. Київ : Кондор.

2. Березуцький, В. В. (2020). Ризик-менеджмент використання обладнання та технологій : навч. посібник. Харків : ФОП Панов А. М.

3. Ризикологія : навч.-метод. посіб. для здобувачів третього (освіт.-наук.) рівня вищої освіти зі спец. «Менеджмент» [Електронне видання] / О. Слободянюк, О. Кібік, В. Котлубай ; Нац. ун-т «Одеська юрид. Академія». – Одеса : Фенікс, 2025. – 78 с. URL: <https://hdl.handle.net/11300/30599> ; DOI: 10.32837/11300.30599

4. Стешенко О. Д. Ризикологія: Навч. посібник. – Харків: УкрДУЗТ, 2019. – 180 с., рис. 24, табл. 8.

5. Методичні вказівки до практичних занять з дисципліни «Ризикологія в економіці, менеджменті та бізнесі» / уклад. Афанасьєв Є.В., Кривий Ріг, 2019. 20с.

6. Варава Л.М., Афанасьєв Є.В., Маркіна І.А., ін. Актуальні проблеми сучасного менеджменту: монографія. Кривий Ріг: Роман Козлов, 2018. 203 с.

7. Бугріменко Р.М., Смірнова П.В. Б 90 Ризикологія: навч. посіб. / Р. М. Бугріменко, П. В. Смірнова. – Харків: ТОВ «Видавництво «Форт», 2022. – 148 с.
8. Рудь О. Інвестиційний ризик-менеджмент: особливості аналізу та оцінки ризиків в інвестиційному проєкті. Економіка та суспільство, (70). <https://doi.org/10.32782/2524-0072/2024-70-127>
9. Економічні ризики та методи їх вимірювання: рекомендації до вивчення дисципліни [Електронний ресурс] : КПП ім. Ігоря Сікорського; уклад. О.В. Кривда – Київ : КПП ім. Ігоря Сікорського, 2022. – 85 с.
10. Кармінська-Белоброва М.В. Управління ризиками у підприємстві: навчальний посібник / укладач, Є.М. Ігнатова, М.В. – Харків: «Слово», 2014 – 169 с.

Система оцінювання

Підсумкова оцінка з освітнього компонента визначається відповідальним лектором за темами, видами занять, тощо у відповідності до силабусу і є інтегральною оцінкою результатів усіх вид навчальної діяльності здобувача вищої освіти. Підсумкова оцінка повинна відображати всі оцінки за складовими навчального процесу з урахуванням їх вагових показників k :

Поточний контроль (практичні, семінарські, лабораторні заняття), k_1	Контрольні роботи (за наявності), k_2	Індивідуальне завдання (за наявності), k_3	Підсумковий контроль (для ОК з іспитом), k_4
0,4	0,2	0,3	0,1

Сума коефіцієнтів повинна складати одиницю: $k_1 + k_2 + k_3 + k_4 = 1$. Підбір вагових коефіцієнтів підсумкової оцінки здійснює розробник курсу.

Розрахунок підсумкової оцінки проводиться за формулою:

$$O = P \cdot k_1 + K \cdot k_2 + I \cdot k_3 + Pk \cdot k_4$$

де: P – середньозважена середня оцінка за поточний контроль
 I – оцінка за виконання індивідуального завдання
 K – середньозважена оцінка за контрольні роботи
 Pk – оцінка за підсумковий контроль

$$P = \frac{P_1 \cdot a_1 + P_2 \cdot a_2 + \dots + P_n \cdot a_n}{\sum_{i=1}^{10} a_i}$$

де: a_i - ваговий коефіцієнт за кожне практичне заняття.

$$K = \frac{K_1 \cdot b_1}{\sum_{i=1}^1 b_i}$$

де: b_i - ваговий коефіцієнт за контрольну роботу.

Поточні оцінки за кожну складову (P, K, I, \dots) виставляються за 100-бальною шкалою згідно з [положенням «Про критерії та систему оцінювання знань та вмінь і про рейтинг здобувачів вищої освіти» НТУ «ХП»](#).

Підсумкова оцінка виставляється відповідно до розрахованої O з округленням до найближчого цілого числа в більшу сторону.

Шкала оцінювання

Сума балів	Національна оцінка	ECTS
90–100	Відмінно	A
82–89	Добре	B
75–81	Добре	C
64–74	Задовільно	D
60–63	Задовільно	E
35–59	Незадовільно (потрібне додаткове вивчення)	FX
1–34	Незадовільно	F

(потрібне повторне
вивчення)

Норми академічної етики і політика курсу

Здобувач вищої освіти повинен дотримуватися «Кодексу етики академічних взаємовідносин та доброчесності НТУ «ХПІ»: виявляти дисциплінованість, вихованість, доброзичливість, чесність, відповідальність. Конфліктні ситуації повинні відкрито обговорюватися в навчальних групах з викладачем, а при неможливості вирішення конфлікту – доводитися до відома співробітників дирекції інституту.

Нормативно-правове забезпечення впровадження принципів академічної доброчесності НТУ «ХПІ» розміщено на сайті: <http://blogs.kpi.kharkov.ua/v2/nv/akademichna-dobrochesnist/>

Погодження

Силабус погоджено

30.08.2025



Завідувач кафедри
Наталія ШМАТЬКО