



Силабус курсу МОДЕЛІ УПРАВЛІННЯ РИЗИКОМ

Ступінь вищої освіти – магістр
Галузь знань – F Інформаційні технології
Спеціальність - F5 Кібербезпека та захист інформації
Освітньо-професійна програма – «Кібербезпека»
Дисципліна циклу: вибіркова
Рік навчання: 1
Семестр: 2
Кількість кредитів: 5
Мова викладання: українська

ППП

Контактна інформація

Керівник курсу

Ірина ДАНИЛЮК

irynadanylyuk9@gmail.com

Опис дисципліни

У сучасних реаліях ринкового економічного середовища діяльність суб'єктів господарювання супроводжується різними видами ризиків. Для прийняття ефективних управлінських рішень на мікро- та макрорівнях суб'єкту господарювання слід не уникати їх, а навчитись керувати ними, використовуючи розроблені у сучасній вітчизняній та зарубіжній літературі методи управління та нейтралізації ризиків, що дозволить звести до мінімуму їх рівень і водночас отримати очікуваний рівень доходу. Тому від сучасного фахівця вимагається правильно оцінити всі можливі варіанти проведення кожної конкретної господарської операції, для чого необхідно оволодіти сучасною, що враховує ризик, методологією аналізу та прийняття раціональних рішень, стратегією і тактикою антикризового управління економічним об'єктом в реальних умовах.

Структура курсу

Години лек/ сем	Тема	Результати навчання	Завдання
2/-	Тема 1. Сутність та види ризиків	Знати поняття ризику, його ймовірнісний характер. Розрізняти ознаки класифікації та види економічних ризиків. Розмежовувати ризики за економічними наслідками.	Поточне опитування
4 /2	Тема 2. Організація управління ризиками	Знати сутність ризик-менеджменту. Застосовувати етапи управління ризиками на практиці	Поточне опитування

4/-	Тема 3. Статистичні методи оцінювання ризиків	Знати загальні принципи оцінки та аналізу ризику, показники підприємницького ризику. Вміти застосовувати метод варіаційного аналізу ризику. Уміти використати імовірнісний метод аналізу ризику на практиці.	Поточне опитування
2/2	Тема 4. Експертні методи оцінювання ризиків	Знати базові характеристики експертних процедур, їх використання для розрахунку рівня ризику проєкту. Застосовувати основні етапи здійснення експертизи на практиці. Розуміти правила визначення сумарних експертних оцінок.	Поточне опитування
4/2	Тема 5. Теорія корисності та схильності до ризику	Розуміти корисність та відношення пріоритетності. Орієнтуватися у функціях корисності. Вміти визначати очікувану корисність та детермінований еквівалент.	Поточне опитування
2/2	Тема 6. Оцінка ризику інвестиційних проєктів.	Знати що таке накопичення та дисконтування, фінансова рента. Вміти здійснити оцінку інвестиційних проєктів в умовах ризику. Використати часову структуру процентних ставок при виборі коефіцієнту з метою оцінки фінансових ризиків.	Поточне опитування
4/2	Тема 7. Основні способи регулювання ризиків	Знати способи зменшення ризиків: страхування, резервування, лімітування та система вибору партнерів. Вміти застосувати інструменти оптимізації ризиків.	Поточне опитування
2/2	Тема 8. Гіпотези та моделі сучасної портфельної теорії	Знати гіпотези портфельної теорії. Вміти використати моделі Тобіна та Марковіца для управління ризиком формування інвестиційного портфеля, модель Шарпа, методи оцінювання доцільності диверсифікації портфеля активів.	Поточне опитування
2/-	Тема 9. Ризики в інвестиційній діяльності	Знати портфельні, стратегічні та венчурні інвестори. Застосовувати критерії оцінок інвестиційних проєктів та розуміти вплив на їх значення ризиковості проєкту.	Поточне опитування

2/-	Тема 10. Прийняття рішень в умовах ризику	Знати теоретико-ігровий підхід до моделювання ризику. Вміти здійснити вибір оптимальної стратегії в умовах ризику. Здійснити постанову задачі прийняття ризикових рішень на основі визначення оцінки можливих виграшів та невдач	Поточне опитування
4/2	Тема 11. Практика управління ризиком	Знати поняття управління ризиком. Уміти застосувати основні підходи до процесу управління ризиком. Здійснювати організаційні заходи щодо управління ризиком в сучасних умовах.	Поточне опитування

Рекомендовані джерела інформації

1. Васильєва Т.А., Кривич Я.М., Леонов С.В. Економічний ризик: методи оцінки та управління :навч. посіб. Суми : ДВНЗ «УАБС НБУ», 2020. - 208 с.
2. Вітлінський В.В. Ризикологія в економіці та підприємстві: монографія // Вітлінський В.В.,Великоіванченко Г.І. – Київ: КНЕУ, 2020. – 480 с.
3. Економіко-математичне моделювання: навчальний посібник. / За ред.. О.Т . Іващука. – Тернопіль:ТНЕУ: Економічна думка, 2020. – 704с.
4. Івченко І.Ю . Моделювання економічних ризиків і ризикових ситуацій. Навч. посібник / І.Ю .Івченко – К.: Центр учбової літератури, 2020. – 344с.
5. Балджи М.Д. Економічний ризик та методи його вимірювання. Навчальний посібник. – Харків:Промарт, 2022. – 300 с.
6. Кучеренко В.Р., Карпов В.А., Карпов А.В. Економічний ризик та методи його вимірювання:Навчальний посібник. – Одеса, 2021. – 200 с.
7. Посохов І.М. Управління ризиками у підприємстві: навчальний посібник / І. М. Посохов. –Харків : НТУ «ХПІ», 2020. – 220 с.
8. Вітлінський В. В. Економічний ризик : ігрові моделі : Навч. посібник / В. В. Вітлінський, П. І.Верченко, А. В. Сігал, Я. С. Наконечний.– К. : КНЕУ, 2022.– 446 с.
9. Мисак Ю. Данилюк І.В. Аналіз даних у маркетингових стратегіях з використанням штучного інтелекту. Збірник тез доповідей II всеукраїнської науково-практичної конференції «Інноваційні підходи до розвитку цифрових технологій та економіки». Свалява, червень 6, 2025. с. 120-123.
10. Старицький Р., Брик Н., Данилюк І.В. Процес управління інвестиційними ризиками. Математичні методи, моделі та інформаційні технології в економіці. Матеріали IX Міжнародної науково-методичної конференції. Чернівці : Чернівець. нац. ун-т ім. Ю. Федьковича, 2025. С. 77-79.
11. Задорожний З. М., Муравський В., Жукевич С., Хома Н., Данилюк І., Башуцький Р. Financial Stability In The Management System Of Enterprises: System Analysis And Formalization Of Assessments In The Conditions Of Sustainable Development. Financial and credit activity problems of theory and practice,2024, 6(59), 234-250.
12. Процько Р.А. Бабала Л.В., Данилюк І.В. Проектування та реалізація комп'ютеризованої системи контролю дотримання вимог безпеки. The 7th International scientific and practical conference “Perspectives of contemporary science: theory and practice” (August 19-21, 2024) SPC “Sci-conf.com.ua”, Lviv, Ukraine. 2024. С. 183-185
13. Danylyuk I. Risk Management in IT-Business. World of finance, 2023, 3 (76),p. 105-114

14. Ковальчук О. Я., Данилюк І. В., Ткачук В. А., Сиротюк А. О. Кластерна модель для підтримки прийняття безпекових рішень. In The 5 th International scientific and practical conference “Science and innovation of modern world”(January 25-27, 2023) Cognum Publishing House, London, United Kingdom. 2023. p. 164.

15. Методи та моделі управління складними системами [Текст] : монографія / О. П. Адамів, О. С. Башуцька, Д. І. Боднар [та ін.] ; за ред. Л. М. Буяк. - Тернопіль : Університетська думка, 2021. - 473 с.

Політика оцінювання

Політика щодо дедлайнів та перескладання: Роботи, які здаються із порушенням термінів без поважних причин, оцінюються на нижчу оцінку (-20 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 з керівником курсу.

Оцінювання

Модуль 1		Модуль 2	Модуль 3	Модуль 4
Поточне оцінювання, 20%	Модульний контроль, 20%	Тренінги, 5%	Самостійна робота, 15%	Іспит, 40%
Визначається як середнє арифметичне оцінок, отриманих на практичних заняттях (кожен здобувач має отримати не менше 4 оцінок)	Підсумкова контрольна робота, яка охоплює всі теми	Визначається оцінка, отримана за виконання завдання під час тренінгу	Визначається оцінка, отримана за виконання завдання самостійної роботи	Теоретичні запитання (2 по 20 балів)- макс. 40 балів Практична задача-макс. 60 балів

Шкала оцінювання

За шкалою ЗУНУ	За національною шкалою	За шкалою ECTS
90-100	відмінно	A (відмінно)
85-89	добре	B (дуже добре)
75-84		C (добре)
65-74	задовільно	D (задовільно)
60-64		E (достатньо)
35-59	незадовільно	FX (незадовільно з можливістю повторного складання)
1-34		F (незадовільно з обов’язковим повторним курсом)