

Міністерство освіти і науки України  
Національний технічний університет «Дніпровська політехніка»  
Навчально-науковий інститут державного управління

Кафедра державного управління і місцевого самоврядування



«ЗАТВЕРДЖЕНО»  
завідувач кафедри

Чикаренко І.А. 

«31» серпня 2022 року

**РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ**  
**«Цифрові моделі ризик-менеджменту**  
**в публічно-управлінській діяльності»**

|                                   |                                            |
|-----------------------------------|--------------------------------------------|
| Галузь знань .....                | 28 Публічне управління та адміністрування  |
| Спеціальність .....               | 281 Публічне управління та адміністрування |
| Рівень вищої освіти .....         | другий (магістерський)                     |
| Статус .....                      | вибіркова, фахова                          |
| Загальний обсяг .....             | 4 кредитів ЄКТС (120 годин)                |
| Форма підсумкового контролю ..... | диференційований залік                     |
| Термін викладання .....           | 1 рік / 2-й семестр / 3 чверть             |
| Мова викладання                   | українська                                 |

Викладач: доц. Старушенко Г. А.

Пролонговано: на 2023/2024 н.р.  (Чикаренко І.А.) «31» серпня 2023 р.  
(підпис, ПІБ, дата)

на 20\_\_/20\_\_ н.р. \_\_\_\_\_ (\_\_\_\_\_) «\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ р.  
(підпис, ПІБ, дата)

Дніпро  
НТУ «ДП»  
2022

Робоча програма навчальної дисципліни «Цифрові моделі ризик-менеджменту в публічно-управлінській діяльності» для магістрів спеціальності 281 «Публічне управління та адміністрування» / Нац. техн. ун-т. «Дніпровська політехніка», кафедра державного управління і місцевого самоврядування. Дніпро : НТУ «ДП», 2022. – 17 с.

Розробники:

Старушенко Галина Аркадіївна – професор, кандидат технічних наук, доцент кафедри державного управління і місцевого самоврядування.

Робоча програма регламентує:

- мету дисципліни;
- дисциплінарні результати навчання;
- базові дисципліни (за наявності);
- обсяг і розподіл за формами організації освітнього процесу та видами навчальних занять;
- програму дисципліни (тематичний план за видами навчальних занять);
- алгоритм оцінювання рівня досягнення дисциплінарних результатів навчання (шкали, засоби, процедури та критерії оцінювання);
- інструменти, обладнання та програмне забезпечення;
- рекомендовані джерела інформації.

Робоча програма призначена для реалізації компетентнісного підходу під час планування освітнього процесу, викладання дисципліни, підготовки магістрів до контрольних заходів, контролю провадження освітньої діяльності, внутрішнього та зовнішнього контролю забезпечення якості вищої освіти, акредитації освітніх програм.

Погоджено рішенням науково-методичної комісії спеціальності 281 «Публічне управління та адміністрування» (протокол № 5 від 28 серпня 2022 р.).

## ЗМІСТ

|                                                                                                    |    |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
| 1. МЕТА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ .....                                                                | 4  |
| 2. ОЧІКУВАНІ ДИСЦИПЛІНАРНІ РЕЗУЛЬТАТИ НАВЧАННЯ .....                                               | 4  |
| 3. БАЗОВІ ДИСЦИПЛІНИ .....                                                                         | 4  |
| 4. ОБСЯГ І РОЗПОДІЛ ЗА ФОРМАМИ ОРГАНІЗАЦІЇ ОСВІТНЬОГО<br>ПРОЦЕСУ ТА ВИДАМИ НАВЧАЛЬНИХ ЗАНЯТЬ ..... | 5  |
| 5. ПРОГРАМА ДИСЦИПЛІНИ ЗА ВИДАМИ НАВЧАЛЬНИХ ЗАНЯТЬ ...                                             | 5  |
| 6. ОЦІНЮВАННЯ РЕЗУЛЬТАТІВ НАВЧАННЯ .....                                                           | 7  |
| 6.1. ШКАЛИ .....                                                                                   | 7  |
| 6.2. ЗАСОБИ ТА ПРОЦЕДУРИ .....                                                                     | 7  |
| 6.3. КРИТЕРІЇ .....                                                                                | 8  |
| 7. ІНСТРУМЕНТИ, ОБЛАДНАННЯ ТА ПРОГРАМНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ                                               | 11 |
| 8. РЕКОМЕНДОВАНІ ДЖЕРЕЛА ІНФОРМАЦІЇ .....                                                          | 11 |

## 1 МЕТА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

**Мета дисципліни** – формування у здобувачів вищої освіти загальних і професійних компетентностей щодо теоретичних та практичних засад побудови цифрових моделей ризик-менеджменту в публічно-управлінській діяльності, з метою адекватної оцінки ризикових ситуацій, прогнозування кінцевого результату, вибору оптимальної стратегії в умовах невизначеності, випадковості та конфлікту задля перетворення невизначеності на можливості.

## 2 ОЧІКУВАНІ ДИСЦИПЛІНАРНІ РЕЗУЛЬТАТИ НАВЧАННЯ

| Дисциплінарні результати навчання (ДРН) |                                                                                                                                                                                                       |
|-----------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| шифр ДРН                                | Зміст                                                                                                                                                                                                 |
| ДРН 1                                   | Продемонструвати <i>розуміння</i> сучасних наукових концепцій стосовно теоретичних питань ризик-менеджменту як системи управління ризиком                                                             |
| ДРН 2                                   | Продемонструвати <i>розуміння</i> цифрових моделей та методів дослідження ризиків в публічно-управлінській діяльності                                                                                 |
| ДРН 3                                   | Продемонструвати <i>знання</i> апарата якісного і кількісного аналізу й оцінки розвитку ризикових ситуацій та способів вибору оптимальної стратегії в умовах невизначеності, випадковості і конфлікту |
| ДРН 4                                   | Продемонструвати <i>знання</i> способів кількісних оцінок конкретних видів ризику з використанням цифрових технологій                                                                                 |
| ДРН 5                                   | Продемонструвати <i>володіння</i> ефективними прийомами управління ризиком                                                                                                                            |
| ДРН 6                                   | Продемонструвати <i>розуміння</i> поняття диверсифікації як способу зниження ризику                                                                                                                   |
| ДРН 7                                   | Продемонструвати <i>вміння</i> застосування цифрових моделей теорії корисності в ризик-менеджменті                                                                                                    |

## 3 БАЗОВІ ДИСЦИПЛІНИ

Міждисциплінарні зв'язки: вивчення курсу ґрунтуються на знаннях, отриманих з вивчених дисциплін за попереднім рівнем вищої освіти.

## 4 ОБСЯГ І РОЗПОДІЛ ЗА ФОРМАМИ ОРГАНІЗАЦІЇ ОСВІТНЬОГО ПРОЦЕСУ ТА ВИДАМИ НАВЧАЛЬНИХ ЗАНЯТЬ

| Вид навчальних занять | Обсяг, години | Розподіл за формами навчання, години |                   |                   |                   |
|-----------------------|---------------|--------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
|                       |               | Денна / Вечірня                      |                   | Заочна            |                   |
|                       |               | аудиторні заняття                    | самостійна робота | аудиторні заняття | самостійна робота |
| лекційні              | 60            | 18                                   | 42                | 4                 | 56                |
| практичні             | 60            | 36                                   | 24                | 6                 | 54                |
| лабораторні           | –             | –                                    | –                 | –                 | –                 |
| семінари              | –             | –                                    | –                 | –                 | –                 |
| РАЗОМ                 | 120           | 54                                   | 66                | 10                | 110               |

## 5 ПРОГРАМА ДИСЦИПЛІНИ ЗА ВИДАМИ НАВЧАЛЬНИХ ЗАНЯТЬ

### 5.1 Тематичний план та розподіл обсягу часу за видами навчальних занять

| Шифри ДРН      | Види та тематика навчальних занять                                                                                                                                                           | Обсяг складових, години |
|----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------|
| <b>ЛЕКЦІЇ</b>  |                                                                                                                                                                                              | <b>60</b>               |
| ДРН 1<br>ДРН 2 | <b>1. Введення. Поняття ризику. Види й класифікація ризиків. Сутність і зміст ризик-менеджменту</b>                                                                                          | 12                      |
|                | 1.1. Ризик як історична й економічна категорії. Об'єкт й суб'єкт ризику. Джерела ризику. Поняття ризик-менеджменту як системи управління ризиком                                             |                         |
|                | 1.2. Стратегія й тактика управління ризиком. Об'єкт й суб'єкт управління в ризик-менеджменті. Інформаційне забезпечення функціонування ризик-менеджменту                                     |                         |
|                | 1.3. Етапи організації ризик-менеджменту. Евристичні прийоми в рішенні ризикових задач. Основні правила ризик-менеджменту                                                                    |                         |
|                | 1.4. Правила стратегії ризик-менеджменту. Правило оптимального поєднання виграшу й величини ризику                                                                                           |                         |
|                | 1.5. Прийоми управління ризиком. Прийоми зниження ступеня ризику                                                                                                                             |                         |
| ДРН 2<br>ДРН 3 | <b>2. Цифрові моделі оцінки ризику в абсолютному вираженні</b>                                                                                                                               | 12                      |
|                | 2.1. Загальні методи оцінки ризику. Якісні та кількісні моделі оцінки ризику. Цифрові моделі оцінки ризику                                                                                   |                         |
|                | 2.2. Ймовірність виникнення збитків порівняно з прогнозованим варіантом як міра ризику                                                                                                       |                         |
|                | 2.3. Зона припустимого ризику; зона критичного ризику; зона катастрофічного ризику                                                                                                           |                         |
|                | 2.4. Міра ризику, визначена за величиною гаданого збитку. Усереднений по ймовірності збиток як міра ризику                                                                                   |                         |
|                | 2.5. Ризик як невідповідність очікуванням; математичне сподівання як міра ризику; середнє квадратичне відхилення як ступінь ризику. Міра ризику, визначена середнім квадратичним відхиленням |                         |
| ДРН 3<br>ДРН 4 | <b>3. Цифрові моделі оцінки ризику у відносному вираженні</b>                                                                                                                                | 12                      |
|                | 3.1. Визначення міри ризику за допомогою коефіцієнта варіації; градація ризиків за коефіцієнтом варіації                                                                                     |                         |
|                | 3.2. Безрозмірні показники ризику; коефіцієнти ризику; шкала градацій ризику за коефіцієнтами ризику                                                                                         |                         |
|                | 3.3. Коефіцієнт покриття ризику. Коефіцієнт ризику планових показників. Шкала градацій ризиків                                                                                               |                         |
|                | 3.4. Допустимий, критичний і катастрофічний ризики. Критерії допустимого, критичного й катастрофічного ризиків                                                                               |                         |

| Шифри ДРН                | Види та тематика навчальних занять                                                                            | Обсяг складових, години |
|--------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------|
| ДРН 5<br>ДРН 6           | <b>4. Диверсифікація як спосіб зниження ризику</b>                                                            | 14                      |
|                          | 4.1. Оцінка ступеня ризику за допомогою нерівності Чебишева                                                   |                         |
|                          | 4.2. Кількісні оцінки за нерівністю Чебишева для заданого розподілу величини ефективності інвестицій          |                         |
|                          | 4.3. Портфель цінних паперів; структура портфеля; ризик портфеля                                              |                         |
|                          | 4.4. Математична модель портфеля з двох акцій                                                                 |                         |
|                          | 4.5. Допустима множина портфелів; ефективна множина портфелів                                                 |                         |
| ДРН 7                    | <b>5. Поняття корисності в ризик-менеджменті</b>                                                              | 10                      |
|                          | 5.1. Поняття корисності. Середня очікувана корисність                                                         |                         |
|                          | 5.2. Функція корисності. Принцип фон Неймана-Моргенштейна                                                     |                         |
|                          | 5.3. Функція несхильності до ризику. Приклади основних функцій корисності                                     |                         |
| <b>ПРАКТИЧНІ ЗАНЯТТЯ</b> |                                                                                                               | <b>60</b>               |
| ДРН 1                    | Евристичні методи оцінки ризику                                                                               | 6                       |
|                          | Метод аналізу доцільності витрат оцінки ризику                                                                |                         |
|                          | Комплексне оцінювання ризиків                                                                                 |                         |
| ДРН 2<br>ДРН 3           | Кількісна оцінка ризику за математичним сподіванням; середнім квадратичним відхиленням; коефіцієнтом варіації | 20                      |
|                          | Оцінка ризику планових показників                                                                             |                         |
|                          | Оцінка систематичного ризику                                                                                  |                         |
|                          | Оцінка ризику за допомогою дерева рішень                                                                      |                         |
|                          | Оцінювання ефективності нововведень                                                                           |                         |
| ДРН 4<br>ДРН 5           | Оцінювання ризику на основі аналізу точки беззбитковості                                                      | 14                      |
|                          | Оцінювання ризику за допомогою методу аналогій                                                                |                         |
|                          | Оцінювання ризику на основі встановлених нормативів                                                           |                         |
| ДРН 6                    | Визначення структури портфеля із заданою ефективністю                                                         | 14                      |
|                          | Оцінка ризику за допомогою нерівності Чебишева                                                                |                         |
| ДРН 7                    | Використання теорії корисності в ризик-менеджменті. Функція несхильності до ризику                            | 6                       |
|                          | Оцінка ставлення до ризику за допомогою функції корисності                                                    |                         |
| <b>РАЗОМ</b>             |                                                                                                               | <b>120</b>              |

## 5.2 Командне / індивідуальне завдання

Командне / індивідуальне завдання «Цифрові моделі кількісної оцінки ризику» полягає у розробленні, презентації результатів та захисті здобувачами вищої освіти статистичного дослідження обраного регіонального ринку товарів.

**Форма проведення:** розроблення, презентація та захист (відповіді на запитання, дискусія) командного / індивідуального завдання перед аудиторією (бажано використовувати MS PowerPoint).

### ***Зміст індивідуального завдання:***

- 1) Оцінити міру й ступінь ризику підприємства.
- 2) Оцінити ризик планових показників діяльності підприємства.
- 3) Оцінити систематичний ризик роботи підприємства.
- 4) Оцінити ризик роботи підприємства.
- 5) Обчислити ризик банкрутства підприємства за допомогою нерівності Чебишева.
- 6) Оцінити ризик при інвестуванні різних видів цінних паперів.
- 7) Сформулювати оптимальний портфель цінних паперів.
- 8) Визначити відношення підприємства до ризику за допомогою функції неохильності до ризику.
- 9) З використанням функції корисності оцінити можливі способи дій, які ведуть до різних результатів.

## **6 ОЦІНЮВАННЯ РЕЗУЛЬТАТІВ НАВЧАННЯ**

Сертифікація досягнень студентів здійснюється за допомогою прозорих процедур, що ґрунтуються на об'єктивних критеріях відповідно до Положення університету «Про оцінювання результатів навчання здобувачів вищої освіти».

Досягнутий рівень компетентностей відносно очікуваних, що ідентифікований під час контрольних заходів, відображає реальний результат навчання студента за дисципліною.

### **6.1 Шкали**

Оцінювання навчальних досягнень здобувачів вищої освіти НТУ «ДП» здійснюється за рейтинговою (100-бальною) та інституційною шкалами. Остання необхідна (за офіційною відсутністю національної шкали) для конвертації (переведення) оцінок мобільних студентів.

#### ***Шкали оцінювання навчальних досягнень студентів НТУ «ДП»***

| <b>Рейтингова</b> | <b>Інституційна</b>       |
|-------------------|---------------------------|
| 90...100          | відмінно / Excellent      |
| 74...89           | добре / Good              |
| 60...73           | задовільно / Satisfactory |
| 0...59            | незадовільно / Fail       |

Кредити навчальної дисципліни зараховуються, якщо здобувач отримав підсумкову оцінку не менше 60-ти балів. Нижча оцінка вважається академічною заборгованістю, що підлягає ліквідації відповідно до Положення про організацію освітнього процесу НТУ «ДП».

### **6.2 Засоби та процедури**

Зміст засобів діагностики спрямовано на контроль рівня сформованості знань, умінь/навичок, комунікації, автономії та відповідальності здобувача за

вимогами НРК до 7-го кваліфікаційного рівня під час демонстрації регламентованих робочою програмою результатів навчання.

Здобувач на контрольних заходах має виконувати завдання, орієнтовані виключно на демонстрацію дисциплінарних результатів навчання (розділ 2).

Засоби діагностики, що надаються здобувачам на контрольних заходах у вигляді завдань для поточного та підсумкового контролю, формуються шляхом конкретизації вихідних даних та способу демонстрації дисциплінарних результатів навчання.

Засоби діагностики (контрольні завдання) для поточного та підсумкового контролю дисципліни затверджуються кафедрою.

Види засобів діагностики та процедур оцінювання для поточного та підсумкового контролю дисципліни подано нижче.

### *Засоби діагностики та процедури оцінювання*

| ПОТОЧНИЙ КОНТРОЛЬ |                                     |                                              | ПІДСУМКОВИЙ КОНТРОЛЬ               |                                                                                                                  |
|-------------------|-------------------------------------|----------------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| навчальне заняття | засоби діагностики                  | процедури                                    | засоби діагностики                 | процедури                                                                                                        |
| лекції            | контрольні завдання за кожною темою | виконання завдань під час лекцій             | комплексна контрольна робота (ККР) | визначення середньозваженого результату поточних контролів;<br>виконання ККР під час заліку за бажанням студента |
| практичні         | індивідуальне завдання              | виконання завдань під час самостійної роботи |                                    |                                                                                                                  |

Під час поточного контролю лекційні заняття оцінюються шляхом визначення якості виконання контрольних конкретизованих завдань. Практичні заняття оцінюються якістю виконання індивідуального завдання.

Якщо зміст певного виду занять підпорядковано декільком складовим, то інтегральне значення оцінки може визначатися з урахуванням вагових коефіцієнтів, що встановлюються викладачем.

За наявності рівня результатів поточних контролів з усіх видів навчальних занять не менше 60 балів, підсумковий контроль здійснюється без участі здобувача шляхом визначення середньозваженого значення поточних оцінок.

Незалежно від результатів поточного контролю кожен здобувач під час заліку має право виконувати ККР, яка містить завдання, що охоплюють ключові дисциплінарні результати навчання.

Кількість конкретизованих завдань ККР повинна відповідати відведеному часу на виконання. Кількість варіантів ККР має забезпечити індивідуалізацію завдання.

Значення оцінки за виконання ККР визначається середньою оцінкою складових (конкретизованих завдань) і є остаточним.

Інтегральне значення оцінки виконання ККР може визначатися з урахуванням вагових коефіцієнтів, що встановлюється кафедрою для кожної складової опису кваліфікаційного рівня НРК.



### 6.3 Критерії

Реальні результати навчання студента ідентифікуються та вимірюються відносно очікуваних під час контрольних заходів за допомогою критеріїв, що описують дії студента для демонстрації досягнення результатів навчання.

Для оцінювання виконання контрольних завдань під час поточного контролю лекційних і практичних занять в якості критерію використовується коефіцієнт засвоєння, що автоматично адаптує показник оцінки до рейтингової шкали:

$$O_i = 100 a/m,$$

де  $a$  – число правильних відповідей або виконаних суттєвих операцій відповідно до еталону рішення;  $m$  – загальна кількість запитань або суттєвих операцій еталону.

Індивідуальні завдання та комплексні контрольні роботи оцінюються експертно за допомогою критеріїв, що характеризують співвідношення вимог до рівня компетентностей і показників оцінки за рейтинговою шкалою.

Зміст критеріїв спирається на компетентнісні характеристики, визначені НРК для магістерського рівня вищої освіти подано нижче.

#### Загальні критерії досягнення результатів навчання для 7-го кваліфікаційного рівня за НРК

| Дескриптори НРК                                                                                                                                                                                                                                           | Вимоги до знань, умінь/навичок, комунікації, відповідальності і автономії                                                                                                                                                                                                                                                | Показник оцінки |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|
| <i>Знання</i>                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                 |
| Спеціалізовані концептуальні знання, що включають сучасні наукові здобутки у сфері професійної діяльності або галузі знань і є основою для оригінального мислення та проведення досліджень, критичне осмислення проблем у галузі та на межі галузей знань | Відповідь відмінна – правильна, обґрунтована, осмислена. Характеризує наявність:<br>- високим ступенем володіння інформацією за питанням;<br>- спеціалізованих концептуальних знань на рівні новітніх досягнень;<br>- критичне осмислення проблем у навчанні та/або професійній діяльності та на межі предметних галузей | 95-100          |
|                                                                                                                                                                                                                                                           | Відповідь містить не суттєві помилки або описки                                                                                                                                                                                                                                                                          | 90-94           |
|                                                                                                                                                                                                                                                           | Відповідь правильна, але має певні неточності                                                                                                                                                                                                                                                                            | 85-89           |
|                                                                                                                                                                                                                                                           | Відповідь правильна, але має певні неточності й недостатньо обґрунтована                                                                                                                                                                                                                                                 | 80-84           |
|                                                                                                                                                                                                                                                           | Відповідь правильна, але має певні неточності, недостатньо обґрунтована та осмислена                                                                                                                                                                                                                                     | 74-79           |
|                                                                                                                                                                                                                                                           | Відповідь фрагментарна                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 70-73           |
|                                                                                                                                                                                                                                                           | Відповідь демонструє нечіткі уявлення студента про об'єкт вивчення                                                                                                                                                                                                                                                       | 65-69           |
|                                                                                                                                                                                                                                                           | Рівень знань мінімально задовільний                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 60-64           |
|                                                                                                                                                                                                                                                           | Рівень знань незадовільний                                                                                                                                                                                                                                                                                               | <60             |

| <b>Уміння/навички</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |        |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| <p>Спеціалізовані уміння/навички розв'язання проблем, необхідні для проведення досліджень та/або провадження інноваційної діяльності з метою розвитку нових знань та процедур;</p> <p>здатність інтегрувати знання та розв'язувати складні задачі у широких або мультидисциплінарних контекстах;</p> <p>здатність розв'язувати проблеми у нових або незнайомих середовищах за наявності неповної або обмеженої інформації з урахуванням аспектів соціальної та етичної відповідальності</p> | Відповідь характеризує уміння:<br>– виявляти проблеми;<br>– формулювати гіпотези;<br>– розв'язувати проблеми;<br>– оновлювати знання;<br>– інтегрувати знання;<br>– провадити інноваційну діяльність;<br>– провадити наукову діяльність                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 95-100 |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | Відповідь характеризує уміння/навички застосовувати знання в практичній діяльності з не грубими помилками                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 90-94  |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | Відповідь характеризує уміння/навички застосовувати знання в практичній діяльності, але має певні неточності при реалізації однієї вимоги                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 85-89  |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | Відповідь характеризує уміння/навички застосовувати знання в практичній діяльності, але має певні неточності при реалізації двох вимог                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 80-84  |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | Відповідь характеризує уміння/навички застосовувати знання в практичній діяльності, але має певні неточності при реалізації трьох вимог                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 74-79  |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | Відповідь характеризує уміння/навички застосовувати знання в практичній діяльності, але має певні неточності при реалізації чотирьох вимог                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 70-73  |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | Відповідь характеризує уміння/навички застосовувати знання в практичній діяльності при виконанні завдань за зразком                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 65-69  |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | Відповідь характеризує уміння/навички застосовувати знання при виконанні завдань за зразком, але з неточностями                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 60-64  |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | Рівень умінь/навичок незадовільний                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | <60    |
| <b>Комунікація</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |        |
| Зрозуміле і недвозначне донесення власних знань, висновків та аргументації до фахівців і нефахівців, зокрема до осіб, які навчаються                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | <p>Зрозумілість відповіді (доповіді).</p> <p><i>Мова:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- правильна;</li> <li>- чиста;</li> <li>- ясна;</li> <li>- точна;</li> <li>- логічна;</li> <li>- виразна;</li> <li>- лаконічна.</li> </ul> <p>Комунікаційна стратегія:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- послідовний і несуперечливий розвиток думки;</li> <li>- наявність логічних власних суджень;</li> <li>доречна аргументації та її відповідність відстоюваним положенням;</li> <li>- правильна структура відповіді (доповіді);</li> <li>- правильність відповідей на запитання;</li> <li>- доречна техніка відповідей на запитання;</li> </ul> <p>здатність робити висновки та формулювати пропозиції;</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- використання іноземних мов у професійній діяльності</li> </ul> | 95-100 |

| Дескриптори НРК                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | Вимоги до знань, умінь/навичок, комунікації, відповідальності і автономії                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | Показник оцінки |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | Достатня зрозумілість відповіді (доповіді) та доречна комунікаційна стратегія з незначними хибами                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 90-94           |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | Добра зрозумілість відповіді (доповіді) та доречна комунікаційна стратегія (сумарно не реалізовано три вимоги)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 85-89           |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | Добра зрозумілість відповіді (доповіді) та доречна комунікаційна стратегія (сумарно не реалізовано чотири вимоги)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 80-84           |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | Добра зрозумілість відповіді (доповіді) та доречна комунікаційна стратегія (сумарно не реалізовано п'ять вимог)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 74-79           |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | Задовільна зрозумілість відповіді (доповіді) та доречна комунікаційна стратегія (сумарно не реалізовано сім вимог)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 70-73           |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | Задовільна зрозумілість відповіді (доповіді) та комунікаційна стратегія з хибами (сумарно не реалізовано дев'ять вимог)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 65-69           |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | Задовільна зрозумілість відповіді (доповіді) та комунікаційна стратегія з хибами (сумарно не реалізовано 10 вимог)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 60-64           |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | Рівень комунікації незадовільний                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | <60             |
| <b><i>Відповідальність і автономія</i></b>                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                 |
| <p>Управління робочими або навчальними процесами, які є складними, непередбачуваними та потребують нових стратегічних підходів;</p> <p>відповідальність за внесок до професійних знань і практики та/або оцінювання результатів діяльності команд та колективів;</p> <p>здатність продовжувати навчання з високим ступенем автономії</p> | <p>Відмінне володіння компетенціями:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- використання принципів та методів організації діяльності команди;</li> <li>- ефективний розподіл повноважень в структурі команди;</li> <li>- підтримка врівноважених стосунків з членами команди (відповідальність за взаємовідносини);</li> <li>- стресовитривалість;</li> <li>- саморегуляція;</li> <li>- трудова активність в екстремальних ситуаціях;</li> <li>- високий рівень особистого ставлення до справи;</li> <li>- володіння всіма видами навчальної діяльності;</li> <li>- належний рівень фундаментальних знань;</li> <li>- належний рівень сформованості загальнонавчальних умінь і навичок</li> </ul> | 95-100          |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | Упевнене володіння компетенціями відповідальності і автономії з незначними хибами                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 90-94           |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | Добре володіння компетенціями відповідальності і автономії (не реалізовано дві вимоги)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 85-89           |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | Добре володіння компетенціями відповідальності і автономії (не реалізовано три вимоги)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 80-84           |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | Добре володіння компетенціями відповідальності і автономії (не реалізовано чотири вимоги)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 74-79           |

| Дескриптори НРК | Вимоги до знань, умінь/навичок, комунікації, відповідальності і автономії                    | Показник оцінки |
|-----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|
|                 | Задовільне володіння компетенціями відповідальності і автономії (не реалізовано п'ять вимог) | 70-73           |
|                 | Задовільне володіння компетенціями відповідальності і автономії (не реалізовано шість вимог) | 65-69           |
|                 | Задовільне володіння компетенціями відповідальності і автономії (рівень фрагментарний)       | 60-64           |
|                 | Рівень відповідальності і автономії незадовільний                                            | <60             |

## 7 ІНСТРУМЕНТИ, ОБЛАДНАННЯ ТА ПРОГРАМНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ

1. Технічні засоби навчання (комп'ютерне та мультимедійне обладнання).
2. Дистанційна платформа Moodle.
3. MS Office (застосунок Teams).

## 8 РЕКОМЕНДОВАНІ ДЖЕРЕЛА ІНФОРМАЦІЇ

### Основні

1. Азаренкова Г. М. Аналіз моделювання і управління ризиком (в схемах та прикладах) : навч. посібник. – Львів: Новий світ-2000, 2011. – 240 с.
2. Боровик М. В. Ризик-менеджмент: конспект лекцій. – Харків: ХНУМГ ім. О. М. Бекетова, 2018. – 65 с.
3. Вітлінський В. В., Наконечний С. І. Ризик у менеджменті. – Київ: ТОВ «Борисфен-М», 1996. – 336 с.
4. Донець Л. І. Економічні ризики та методи їх вимірювання : навч. посібник. – Київ: Центр навчальної літ-ри, 2006. – 312 с.
5. Кузьмін О. Є., Вербницька Г. Л., Мельник О. Г. Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків : навч. посібник. – Львів : Вид-во Нац. ун-ту «Львівська політехніка», 2008. – 212 с
6. Машина Н. І. Економічний ризик та методи його вимірювання: Навчальний посібник. – Київ: Центр навчальної літ-ри, 2003. – 188 с.
7. Старостіна А. О., Кравченко В. А. Ризик-менеджмент: теорія та практика : навч. посібник. – Київ: ІВЦ «Вид-во «Політехніка», 2004. – 200 с.

### Нормативні документи

1. Про внесення змін до Методики розроблення, проведення моніторингу та оцінки результативності реалізації регіональних стратегій розвитку та планів заходів з їх реалізації : наказ Міністерства регіонального розвитку, будівництва та житлово-комунального господарства України від 27 груд. 2018 р. № 373 // <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/z0082-19>.
2. Про державне прогнозування та розроблення програм економічного і соціального розвитку України : Закон України від 23 берез. 2000 р. № 1602-III.

3. Про затвердження Державної стратегії регіонального розвитку на 2021-2027 роки : Постанова Кабінету Міністрів України від 5 серп. 2020 р. № 695 // <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/695-2020-%D0%BF#Text>.

4. Про затвердження Методики розроблення, проведення моніторингу та оцінки результативності реалізації регіональних стратегій розвитку та планів заходів з їх реалізації : наказ Міністерства регіонального розвитку, будівництва та житлово-комунального господарства України від 31 берез. № 79 // <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/z0082-19>.

5. Про затвердження Методики формування спроможних територіальних громад : Постанова Кабінету Міністрів України від 08 квіт. 2015 р. № 214 // <https://zakon3.rada.gov.ua/laws/show/214-2015-п>.

6. Про затвердження Методичних рекомендацій щодо формування і реалізації прогнозних та програмних документів соціально-економічного розвитку об'єднаної територіальної громад : наказ Міністерства регіонального розвитку, будівництва та житлово-комунального господарства України від 30 бер. 2016 № 75 // [https://cct.com.ua/2016/30.03.2016\\_75.htm](https://cct.com.ua/2016/30.03.2016_75.htm).

7. Про затвердження Порядку розроблення регіональних стратегій розвитку і планів заходів з їх реалізації, а також проведення моніторингу та оцінки результативності реалізації зазначених регіональних стратегій і планів заходів : Постанова Кабінету Міністрів України від 11 лис. 2015 р. № 932 // <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/932-2015-%D0%BF#Text>.

8. Національна доповідь «Цілі сталого розвитку: Україна» / Міністерство економічного розвитку і торгівлі України, 2017. – 174 с. // [http://un.org.ua/images/SDGs\\_NationalReportUA\\_Web\\_1.pdf](http://un.org.ua/images/SDGs_NationalReportUA_Web_1.pdf).

9. Цілі сталого розвитку 2030 / ООН в Україні // <http://www.un.org.ua/ua/tsili-rozvytku-tysiacholittia/tsili-staloho-rozvytku>.

#### Додаткові

1. Верченко П. І. Багатокритеріальність і динаміка економічного ризику (моделі та методи): монографія. – Київ: КНЕУ, 2006. – 272 с.

2. Вітлінський В. В. Аналіз, оцінка й моделювання ризику: монографія. – Київ: ДЕМІУР, 1996. – 212 с.

3. Вітлінський В. В. Економічний ризик: ігрові моделі: навч. посібник / В. В. Вітлінський, П. І. Верченко, А. В. Сігал, Я. С. Наконечний. – Київ: КНЕУ, 2002. – 446 с.

4. Вітлінський В. В. Моделювання економіки: навч. посібник. – Київ: КНЕУ, 2003. – 408 с.

5. Волинець І. І. Організація ризик-менеджменту на підприємстві. – Економічний часопис Східноєвропейського нац. ун-ту ім. Лесі Українки, 2016. – № 2. – С. 51–55.

6. Гранатуров В. М., Литовченко І. В., Харічков С. К. Аналіз підприємницьких ризиків : проблеми визначення, класифікації та кількісної оцінки: монографія. – Одеса: Інститут проблем ринку та економіко-екологічних досліджень НАН України, 2003. – 164 с.

7. Долінський Л. Б. Корчинський В. В. Ідентифікація та кількісне оцінювання кредитного ризику комерційного банку. – Економічний аналіз, 2016. – Т. 25. – № 1. – С. 180–189.
8. Дуднева Ю. Е. Ризик-менеджмент: інтегрований підхід до організації. – Електронне наукове фахове видання Мукачівського держ. ун-ту «Економіка та суспільство», 2019. – № 20. – С. 229–236.
9. Д'яконова І. І., Шиян Д. В. Методика оцінки ефективності фінансового моніторингу. – Вісник Української академії банківської справи, 2013. – № 1 (34). – С. 10–16.
10. Дячков Д. В. Формування системи ризик-менеджменту підприємства. Економічний форум, 2015. – № 4. – С. 235–241.
11. Єпіфанов А. О., Васильєва Т. А., Козьменко С. М. Управління ризиками базових банківських операцій: монографія. – Суми: ДВНЗ «УАБС НБУ», 2012. – 283 с.
12. Кльоба Л. Г. Напрями вдосконалення управління банківськими ризиками. – Економіка та держава, 2018. – № 6. – С. 80–85.
13. Корж Н. В. Методи управління фінансовими ризиками. – Теорія та практика науки, 2016. – № 10. – С. 11–16.
14. Лагунова І. А. Сутність та принципи концепції ризик-менеджменту. – Актуальні проблеми державного управління, 2018. – № 1 (53). – С. 44–52.
15. Лепа Р. М., Тимохин В. М. Прийняття управлінських рішень на підприємстві : теорія та практика : монографія. – Донецьк : ТОВ «Юго-Восток, Лтд», 2004. – 262 с.
16. Лисенко О. В., Мелоян О. Г. Управління ризиками банку в системі внутрішнього фінансового моніторингу. – Вісник ЖДТУ, 2015. – № 3. – С. 145–152.
17. Лук'янова В. В., Головач Т. В. Економічний ризик: навч. посібник. – Київ: Академвидав, 2007. – 464 с.
18. Моделі і методи соціально-економічного прогнозування: підручник / В. М. Геєць, Т. С. Клебанова, О. І. Черняк та ін. – 2-е вид., виправ. – Харків: ВД «ІНЖЕК», 2008. – 396 с.
19. Москаленко Н. В., Климчук Н. Я. Управління ризиками легалізації доходів одержаних злочинним шляхом. – Університет державної фіскальної служби України, 2017. – № 1. – С. 183–194.
20. Мостенська Т. Л., Скопенко Н. С. Ризик-менеджмент як інструмент управління господарським ризиком підприємства. – Вісник Запорізького нац. ун-ту. – 2010. – № 3 (7). – С. 72–79.
21. Подчесова В. Ю. Управління кредитними ризиками та шляхи їх мінімізації. Економіка: проблеми теорії та практики, 2005. – Т. 4. – № 205. – С. 967–972.
22. Серьогін С. С., Водяницька О. В., Соколова Н. В. Особливості управління банківськими ризиками. – Мукачевський держ. ун-т, 2018. – № 16. – С. 700–704.
23. Стрельбіцька Н. Є. Становлення та розвиток міжнародних стандартів управління ризиками. – Вісник КНТЕУ, Київ. – 2008. – № 6. – С. 84–93.

24. Старушенко Г. А., Кравцов О. В. Методичні вказівки до виконання практичних завдань з курсу «Управління ризиком»: У 2 ч. Частина І. – Дніпропетровськ: ДРІДУ НАДУ, 2008. – 44 с.
25. Старушенко Г. А., Кравцов О. В. Методичні вказівки до виконання практичних завдань з курсу «Управління ризиком»: У 2 ч. Частина ІІ. – Дніпропетровськ: ДРІДУ НАДУ, 2008. – 80 с.
26. Страхарчук В. П. Концептуальні засади кількісної оцінки ризиків. Проблеми і перспективи розвитку банківської системи України, 2004. – Т. 9. – С. 278–287.
27. Тимошик Н. С. Формування ефективної системи управління фінансовими ризиками. Формування механізму зміцнення конкурентних позицій національних економічних систем у глобальному, регіональному та локальному вимірах: зб. тез доп. Міжнар. наук.-практ. конф., м. Тернопіль, 29–31 берез. 2019 р., Тернопіль, 2018. – Т. 1. – С. 61–63.
28. Шегда А. В., Голованенко М. В. Ризики в підприємстві: оцінювання та управління: навч. посібник ; за ред. А. В. Шегди. – Київ: Знання, 2008. – 271 с.
29. Глібчук В. М. Сутність ризику як економічної категорії. – Нац. ун-т «Львівська політехніка», 2007 // [http://ena.lp.edu.ua:8080/bitstream/ntb/35530/1/16\\_102-107.pdf](http://ena.lp.edu.ua:8080/bitstream/ntb/35530/1/16_102-107.pdf).
30. Грінчук А. Л. Ризики банківської діяльності та основні методи оцінки. Репозитарій Харківського національного економічного університету ім. Семена Кузнеця, 2013 // <http://repository.hneu.edu.ua>.
31. Дядюк М. А. Управління ризиками: консп. лекц. – Харків: Форт, 2017. – С. 165 // <http://elib.hduht.edu.ua/jspui/handle/123456789/1893>.
32. Мороз І. О. Сутність управління ризиками підприємства та навички, необхідні менеджеру для його провадження: зб. тез Всеукраїнської науково-практичної online конференції аспірантів, молодих учених та студентів ЖДТУ, 2017. – Т. 2. // <http://eztuir.ztu.edu.ua/123456789/6819>.
33. Мороз В. М., Мороз С. А. Ризик-менеджмент : навч. посібник для студ. спец. 281 «Публічне управління та адміністрування». – Харків: НТУ «ХПІ», 2018. – 140 с. // [http://repository.kpi.kharkov.ua/bitstream/KhPI-Press/39143/1/Book\\_2018\\_Moroz\\_Ryzyk\\_menedzhment.pdf](http://repository.kpi.kharkov.ua/bitstream/KhPI-Press/39143/1/Book_2018_Moroz_Ryzyk_menedzhment.pdf).
34. Стрельбіцька Н. Уніфікований міжнародний стандарт ризик-менеджменту як відповідь на виклики глобалізації // <https://core.ac.uk/download/pdf/60789266.pdf>.
35. Система управління ризиками підприємства ISO 31000 // <https://www.sciencetr.com/uk/belgelendirme/sistem-belgelendirme/iso-31000-kurumsal-risk-yonetim-sistemi>.
36. Сірік І. П. Методичні підходи до обґрунтування управлінських рішень. Ефективна економіка // <http://www.economy.nayka.com.ua/index.php?operation=1&iid=623>.
37. Третяк Д. Д., Душейко П. А. Теоретичні аспекти ризик-менеджменту банку // <http://www.economy.in.ua/?op=1&z=5108&i=17>.

### **Інформаційні ресурси**

1. «ТРЕМБІТА». Система електронної взаємодії державних електронних інформаційних ресурсів. URL: <https://trembita.gov.ua>.
2. ISO 31000:2009 Risk management – Principles and guidelines. URL: <https://www.iso.org/ru/standard/43170.html>.
3. Risk Management. URL: <https://corporatefinanceinstitute.com/resources/knowledge/strategy/risk-management/>
4. What is Risk Management? URL: <https://www.ibm.com/topics/risk-management>.
5. Аспекти публічного управління. URL: [www.aspects.org.ua](http://www.aspects.org.ua).
6. Національна бібліотека України ім. В. Вернадського. URL: <http://www.nbuv.gov.ua/>.



Навчальне видання  
**Робоча програма вибіркової навчальної дисципліни**  
**«Цифрові моделі ризик-менеджменту**  
**в публічно-управлінській діяльності»**  
для здобувачів другого (магістерського) рівня вищої освіти  
всіх спеціальностей

Розробник:  
Старушенко Галина Аркадіївна

Підготовлено до виходу в світ  
у Національному технічному університеті  
«Дніпровська політехніка».  
Свідоцтво про внесення до Державного реєстру ДК № 1842  
4960050, м. Дніпро, просп. Д. Яворницького, 19