**Міністерство освіти і науки України**

**Національний технічний університет**

**"Дніпровська політехніка"**

**Фінансово-економічний факультет**

**Кафедра економіки та економічної кібернетики**

|  |  |
| --- | --- |
|  | **«ЗАТВЕРДЖЕНО»**завідувач кафедри Чуріканова О.Ю.  «30» серпня2022 р. |

**РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ**

**«Управління ризиками**»

|  |  |
| --- | --- |
| Галузь знань …………….… | 05 Соціальні та поведінкові науки |
| Спеціальність ……………... | 051 Економіка |
| Освітній рівень……………. | магістр |
| Освітня програма …………. | Цифрова економіка |
| Спеціалізація ……………… | Цифрова економіка |
| Вид дисципліни …………… | Вибіркова |
| Кількість кредитів ЕСТS … | 3 кредити ЄКТС (90 годин) |
| Форма підсумкового контролю ………………….. | екзамен |
| Термін викладання ……….. | 2-й семестр |
| Мова викладання …………. | українська |

Викладачі: Пістунов І.М.

Пролонговано: на 2023/2024\_ н.р. (О.Ю. Чуріканова) «12» червня 2023р.

 (підпис, ПІБ, дата)

 на 20\_\_/20\_\_ н.р. \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_(\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_) «\_\_»\_\_\_ 20\_\_р.

 (підпис, ПІБ, дата)

Дніпро

НТУ «ДП»

2020

Робоча програма навчальної дисципліни «Управління ризиками» для магістрів спеціальності 051 «Економіка» / І.М. Пістунов; Нац. техн. ун-т. «Дніпровська політехніка», каф. екон. та екон. кібернетики. – Д. : НТУ «ДП», 2020. – 12 с.

Розробник – Пістунов І.М.

Робоча програма регламентує:

* мету дисципліни;
* дисциплінарні результати навчання, сформовані на основі трансформації очікуваних результатів навчання освітньої програми;
* базові дисципліни;
* 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 студентів до контрольних заходів, контролю провадження освітньої діяльності, внутрішнього та зовнішнього контролю забезпечення якості вищої освіти, акредитації освітніх програм у межах спеціальності.

Робоча програма буде в пригоді для формування змісту підвищення кваліфікації науково-педагогічних працівників кафедр університету.

Погоджено рішенням методичної комісії спеціальності 051 Економіка (протокол № 1 від 28.08.2020 року).

**ЗМІСТ**

[1 МЕТА НАВЧАЛЬНОЇ ДИЦИПЛІНИ](#_Toc534664485) 4

[2 ОЧІКУВАНІ ДИСЦИПЛІНАРНІ РЕЗУЛЬТАТИ НАВЧАННЯ](#_Toc534664486) 4

[3 БАЗОВІ ДИСЦИПЛІНИ](#_Toc534664487) 5

[4 ОБСЯГ І РОЗПОДІЛ ЗА ФОРМАМИ ОРГАНІЗАЦІЇ ОСВІТНЬОГО ПРОЦЕСУ ТА ВИДАМИ НАВЧАЛЬНИХ ЗАНЯТЬ](#_Toc534664488) 5

[5 ПРОГРАМА ДИСЦИПЛІНИ ЗА ВИДАМИ НАВЧАЛЬНИХ ЗАНЯТЬ](#_Toc534664489) 6

[6 ОЦІНЮВАННЯ РЕЗУЛЬТАТІВ НАВЧАННЯ](#_Toc534664490) 7

[6.1 Шкали](#_Toc534664491) 7

[6.2 Засоби та процедури](#_Toc534664492) 8

[6.3 Критерії](#_Toc534664493) 9

[7 ІНСТРУМЕНТИ, ОБЛАДНАННЯ ТА ПРОГРАМНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ](#_Toc534664494) 12

[8 РЕКОМЕНДОВАНІ ДЖЕРЕЛА ІНФОРМАЦІЇ](#_Toc534664495) 13

# **1 МЕТА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ**

В освітньо-професійній програмі НТУ «Дніпровська політехніка» спеціальності 051 «Економіка» здійснено розподіл програмних результатів навчання за організаційними формами освітнього процесу. До дисципліни В1.6 «Управління ризиками» віднесені такі результати навчання:

СР1.3 Прогнозувати наслідки реалізації прийнятих рішень у соціальній, економічній, виробничій, споживацькій та інших сферах життєдіяльності суспільства.

СР1.4 Управляти економічними процесами та ризиками

СР1.5 Удосконалювати відомі та розробляти нові методи, способи та засоби теоретичних та експериментальних досліджень в галузі економічної кібернетики.

ВР1.2 Здійснювати проектування бізнес-процесів організацій

Мета дисципліни – формування у майбутніх магістрів знань і навичок знань і навичок щодо сучасних методів розрахунку, планування, зменшення та запобігання ризику в економічній діяльності.

Реалізація мети вимагає формування у майбутніх магістрів теоретичних основ і прийомів теоретичних основ і порядку визначення ризику та методів його зменшення необхідно для виконання професійних функцій магістрів з економічної кібернетики.

# **2 ОЧІКУВАНІ ДИСЦИПЛІНАРНІ РЕЗУЛЬТАТИ НАВЧАННЯ**

| **Шифр****ПРН** | **Дисциплінарні результати навчання (ДРН)** |
| --- | --- |
| **шифр ДРН** | **зміст** |
| СР1.3 | СР1.3-1 | Вміти здійснювати кількісну оцінку ризику, визначати ризик окремої операції.  |
| СР1.3-2 | Знати загальні вимірники ризику. |
| СР1.3-3 | Вміти визначати ризик розорення, показники ризику у вигляді відносин, кредитний ризик, депозитний ризик |
| СР1.4 | СР1.4-1 | Знати та вміти використовувати загальні методи зменшення ризиків: диверсифікацію, хеджування, страхування.  |
| СР1.4-2 | Вміти здійснювати якісне управління ризиками. Вміти приймати фінансові рішення в умовах ризику. Розуміти динамічні моделі планування фінансів.  |
| СР1.4-3 | Вміти здійснювати оцінку поточної вартості фірми, оцінку перспективного проекту, визначати коефіцієнти дисконтування для ризикованого проекту, знати альтернативні методи прийняття проекту |
| СР1.5 | СР1.5-1 | Удосконалювати відомі та розробляти нові методи, способи та засоби теоретичних та експериментальних досліджень в галузі управління ризиками, оцінювання ризиків. |
| ВР1.2 | ВР1.2-1 | Здійснювати проектування бізнес-процесів організацій з урахуванням ризиків |

# **3 БАЗОВІ ДИСЦИПЛІНИ**

| **Назва дисципліни** | **Здобуті результати навчання** |
| --- | --- |
| Ф 2. Математичне моделювання систем  | Формулювати, аналізувати та синтезувати рішення науково-практичних проблем на абстрактному рівні шляхом декомпозиції їх на складові; вибирати та використовувати необхідний науковий, методичний і аналітичний інструментарій для управління економічною діяльністю; збирати, обробляти та аналізувати статистичні дані, науково-аналітичні матеріали, необхідні для вирішення комплексних економічних завдань; Обґрунтовувати рішення в умовах невизначеності, що потребують застосування нових підходів та економіко-математичного моделювання та прогнозування. |

# **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 | аудиторні заняття | самостійна робота |
| лекційні | 45 | 18 | 27 |  |  | 4 | 41 |
| практичні | 45 | 18 | 27 |  |  | 4 | 41 |
| лабораторні | - | - | - |  |  | - | - |
| семінари | - | - | - |  |  | - | - |
| РАЗОМ | 90 | 36 | 54 |  |  | 8 | 82 |

# **5 ПРОГРАМА ДИСЦИПЛІНИ ЗА ВИДАМИ НАВЧАЛЬНИХ ЗАНЯТЬ**

| **Шифри ДРН** | **Види та тематика навчальних занять** | **Обсяг складових,** *години* |
| --- | --- | --- |
|  | **ЛЕКЦІЇ** | **45** |
| СР1.3-1СР1.3-2СР1.3-3СР1.4-1СР1.4-2СР1.4-3СР1.5-1ВР1.2-1 | Розділ 1 РИЗИК І ЙОГО ВИМІРЮВАННЯ1.1. Кількісна оцінка ризику1.2. Ризик окремої операції1.3. Деякі загальні вимірники ризику1.4. Ризик розорення1.5. Показники ризику у вигляді відносин1.6. Кредитний ризик1.7. Депозитний ризик | **9** |
| СР1.3-1СР1.3-2СР1.3-3СР1.4-1СР1.4-2СР1.4-3СР1.5-1ВР1.2-1 | Розділ 2 ЗАГАЛЬНІ МЕТОДИ ЗМЕНШЕННЯ РИЗИКІВ2.2. Диверсифікація2.2. Хеджування2.3. Страхування2.4. Якісне управління ризиками2.5. Форвардна і ф'ючерсна торгівля2.6. Оптимізація статистичного контроль партії готових виробів2.7.2.7. Оптимальний запас продукції торгової фірми | **9** |
| СР1.3-1СР1.3-2СР1.3-3СР1.4-1СР1.4-2СР1.4-3СР1.5-1ВР1.2-1 | Розділ 3 ФІНАНСОВІ РІШЕННЯ В УМОВАХ РИЗИКУ3.1. Динамічні моделі планування фінансів3.2. Оцінка поточної вартості фірми3.2.1. Чиста приведена вартість (безризикова ситуація)3.2.2. Коефіцієнти дисконтування для ризикованого проекту3.3. Оцінка перспективного проекту3.4. Альтернативні методи прийняття проекту | **9** |
| СР1.3-1СР1.3-2СР1.3-3СР1.4-1СР1.4-2СР1.4-3СР1.5-1ВР1.2-1 | Розділ 4 ФУНКЦІЯ КОРИСНОСТІ НЕЙМАНА – МОРГЕНШТЕРНА4.1. Основні визначення і аксіоми4.2. Вимірювання відношення до ризику4.3. Страхування від ризику | **9** |
| СР1.3-1СР1.3-2СР1.3-3СР1.4-1СР1.4-2СР1.4-3СР1.5-1ВР1.2-1 | Розділ 5 СТРАТЕГІЧНА ГРА5.1. Основні поняття теорії стратегічної гри5.2.Зв'язок матричної гри з лінійним програмуванням 5.3. Змішані стратегії5.4. Рішення задач в змішаних стратегіях для матриці 2х25.5. Мажорування (домінування) стратегій | **9** |
|  | **ПРАКТИЧНІ ЗАНЯТТЯ** | **45** |
| СР1.3-1СР1.3-2СР1.3-3СР1.4-1СР1.4-2СР1.4-3СР1.5-1ВР1.2-1 | 1.Ризик і його вимірювання2. Загальні методи зменшення ризиків3 Фінансові рішення в умовах ризику4 Функція корисності Неймана – Моргенштерна5 Стратегічна гра6. Ігри з природою7 Статистична гра | 6666777 |
| РАЗОМ | **90** |

6 ОЦІНЮВАННЯ РЕЗУЛЬТАТІВ НАВЧАННЯ

Сертифікація досягнень студентів здійснюється за допомогою прозорих процедур, що ґрунтуються на об’єктивних критеріях відповідно до «Положення 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 студентів 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»***

|  |  |
| --- | --- |
| **Рейтингова** | **Інституційна** |
| 90…100 | відмінно / Excellent |
| 74…89 | добре / Good |
| 60…73 | задовільно / Satisfactory |
| 0…59 | незадовільно / Fail |

Кредити навчальної дисципліни зараховується, якщо студент отримав підсумкову оцінку не менше 60-ти балів. Нижча оцінка вважається академічною заборгованістю, що підлягає ліквідації.

6.2 Засоби та процедури

Зміст засобів діагностики спрямовано на контроль рівня сформованості знань, умінь, комунікації, автономності та відповідальності студента за вимогами НРК до 8-го кваліфікаційного рівня під час демонстрації регламентованих робочою програмою результатів навчання.

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

Засоби діагностики, що надаються студентам 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 завдання під час лекцій | комплексна контрольна робота (ККР) | визначення середньозваженого результату поточних контролів;виконання ККР під час екзамену за бажанням студента |
| практичні | контрольні завдання за кожною темою | виконання завдань під час практичних занять |
| або 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 контрольного або індивідуального завдання.

Якщо зміст певного виду занять підпорядковано декільком дескрипторам, 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 студента шляхом визначення середньозваженого значення поточних оцінок.

Незалежно від результатів поточного контролю кожен студент під час екзамену 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 кожного дескриптора 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 критерія використовується коефіцієнт засвоєння, що автоматично адаптує показник оцінки до рейтингової шкали:

О*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 компетентністні характеристики, визначені НРК для магістерського рівня вищої освіти (подано нижче).

***Загальні критерії досягнення результатів навчання***

***для 8-го кваліфікаційного рівня за НРК***

**Інтегральна компетентність** – здатність розв’язувати складні задачі і проблеми у певній галузі професійної діяльності або у процесі навчання, що передбачає проведення досліджень та/або здійснення інновацій та характеризується невизначеністю умов і вимог.

| **Дескриптори НРК** | **Вимоги до знань, умінь, комунікації, автономності та відповідальності** | **Показник****оцінки**  |
| --- | --- | --- |
| ***Знання***  |
| * спеціалізовані концептуальні знання, набуті у процесі навчання та/або професійної діяльності на рівні новітніх досягнень, які є основою для оригінального мислення та інноваційної діяльності, зокрема в контексті дослідницької роботи;
* критичне осмислення проблем у навчанні та /або професійній діяльності та на межі предметних галузей
 | Відповідь відмінна – правильна, обґрунтована, осмислена.Характеризує наявність:* спеціалізованих концептуальних знань на рівні новітніх досягнень;
* критичне осмислення проблем у навчанні та/або професійній діяльності та на межі предметних галузей
 | 95-100 |
| Відповідь містить негрубі 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 |
| ***Уміння*** |
| * розв’язання складних задач і проблем, що потребує оновлення та інтеграції знань, часто в умовах неповної/недостатньої інформації та суперечливих вимог;
* провадження дослідницької та/або інноваційної діяльності
 | Відповідь характеризує уміння:* виявляти проблеми;
* формулювати гіпотези;
* розв’язувати проблеми;
* оновлювати знання;
* інтегрувати знання;
* провадити інноваційну діяльность;
* провадити наукову діяльність
 | 95-100 |
| Відповідь характеризує уміння застосовувати знання в практичній діяльності з негрубими помилками | 90-94 |
| Відповідь характеризує уміння застосовувати знання в практичній діяльності, але має певні неточності при реалізації однієї вимоги  | 85-89 |
| Відповідь характеризує уміння застосовувати знання в практичній діяльності, але має певні неточності при реалізації двох вимог | 80-84 |
| Відповідь характеризує уміння застосовувати знання в практичній діяльності, але має певні неточності при реалізації трьох вимог | 74-79 |
| Відповідь характеризує уміння застосовувати знання в практичній діяльності, але має певні неточності при реалізації чотирьох вимог | 70-73 |
| Відповідь характеризує уміння застосовувати знання в практичній діяльності при виконанні завдань за зразком | 65-69 |
| Відповідь характеризує уміння застосовувати знання при виконанні завдань за зразком, але з неточностями | 60-64 |
| Рівень умінь незадовільний | <60 |
| ***Комунікація*** |
| * зрозуміле і недвозначне донесення власних висновків, а також знань та пояснень, що їх обґрунтовують, до фахівців і нефахівців, зокрема до осіб, які навчаються;
* використання іноземних мов у професійній діяльності
 | Зрозумілість відповіді (доповіді). Мова:* правильна;
* чиста;
* ясна;
* точна;
* логічна;
* виразна;
* лаконічна.

Комунікаційна стратегія:* послідовний і несуперечливий розвиток думки;
* наявність логічних власних суджень;
* доречна аргументації та її відповідність відстоюваним положенням;
* правильна структура відповіді (доповіді);
* правильність відповідей на запитання;
* доречна техніка відповідей на запитання;
* здатність робити висновки та формулювати пропозиції;
* використання іноземних мов у професійній діяльності
 | 95-100 |
| 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 |
| ***Автономність та відповідальність*** |
| * відповідальність за розвиток професійного знання і практик, оцінку стратегічного розвитку команди;
* здатність до подальшого навчання, яке значною мірою є автономним та самостійним
 | Відмінне володіння компетенціями:* використання принципів та методів організації діяльності команди;
* ефективний розподіл повноважень в структурі команди;
* підтримка врівноважених стосунків з членами команди (відповідальність за взаємовідносини);
* стресовитривалість;
* саморегуляція;
* трудова активність в екстремальних ситуаціях;
* високий рівень особистого ставлення до справи;
* володіння всіма видами навчальної діяльності;
* належний рівень фундаментальних знань;
* належний рівень сформованості загальнонавчальних умінь і навичок
 | 95-100 |
| Упевнене володіння компетенціями автономності та відповідальності з незначними хибами | 90-94 |
| Добре володіння компетенціями автономності та відповідальності (не реалізовано дві вимоги) | 85-89 |
| Добре володіння компетенціями автономності та відповідальності (не реалізовано три вимоги) | 80-84 |
| Добре володіння компетенціями автономності та відповідальності (не реалізовано чотири вимоги) | 74-79 |
| Задовільне володіння компетенціями автономності та відповідальності (не реалізовано п’ять вимог) | 70-73 |
| Задовільне володіння компетенціями автономності та відповідальності (не реалізовано шість вимог) | 65-69 |
| Задовільне володіння компетенціями автономності та відповідальності (рівень фрагментарний) | 60-64 |
| Рівень автономності та відповідальності незадовільний | <60 |

# **7 ІНСТРУМЕНТИ, ОБЛАДНАННЯ ТА ПРОГРАМНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ**

Технічні засоби навчання.

Дистанційна платформа Мoodlе.

# **8 РЕКОМЕНДОВАНІ ДЖЕРЕЛА ІНФОРМАЦІЇ**

1. Дорошенко М. Н., Беляев Ю. Б. Алгоритм вычисления затрат инвестора по сечениям инвестиционного процесса. // Автоматизація виробничих процесів. - 1999. - №2(9). - с.89-91.

2. Дубров А.М., Лагоша Б.А., Хрусталев Е.Ю. Моделирование рисковых ситуаций в экономике и бизнесе. – М. Финансы и статистика, 1999.–168 с.

3. Енциклопедія кібернетики. Головна редакція українських радянських енциклопедій. т1 та 2, – Київ, 1973. – 680 с.

4. Ильяшенко С.М., Божкова В.В. Инновации и риск: проявления, проблемы учета и управления экологическими рисками // Методы решения экологических проблем / Под ред. Л.Г.Мельника - Сумы: Изд-во "Университетская книга", 2001. - С. 82-97.

5. Малыхин В.И. Финансовая математика. – М: ЮНИТИ-ДАНА, 2000.– 187 с.

6. Пістунов І.М. Лобова Н.В. Теорія ймовірності та математична статистика для економістів. З елементами електронних таблиць: Навчальний посібник. - Дніпропетровськ: РВК НГУ, 2005. -110с.

7. Пістунов І.М., Пістунова К.І. Оптимальні рішення в інвестиційному проектуванні : Навч. посібник. - Д.: НГУ, 2007.- 108 с..

8. Приварникова А.О. Связь между двухкритериальными и стохастическими задачами формирования оптимального портфеля ценных бумаг // Математика. Компьютер. Образование: Сб. науч.тр. - Вып.6. -Ч.2/Под ред. Г.Ю. Ризниченко. - М.: Прогресс - Традиция, 1999. - С. 585-589.

9. Хованов Н.В. Математические модели риска и неопределенности. СПб.: СПбГУ, 1998

10. Черданцева І.Г. Деякі аспекти врахування інвестиційних факторів при оцінці підприємницьких ризиків на регіональному рівні. // Вісник Технологічного університету Поділля. – 1999. – №5. Ч.1. – С.151-154.

11. Шевчук О.Б. Удосконалення методів обґрунтування інвестиційних проектів в системі бізнес-планування з урахуванням ризику // Тр. Одесского политехнического университета. – 1999, вып. 1(10). – С.248-252

12. Шумлянська О.І. Оцінка ризику планових рішень в управлінні судноплавними компаніями// Розвиток методів управління та господарювання на транспорті. Випуск 5. – Одеса: ОДМУ. – 1999. – С. 142 – 154.

13 Ющенко В.А., Міщенко В.І. Управління валютними ризиками: Навчальний посібник. – К.: Товариство “Знання”, КОО. – 1998. – 444 с.