



СИЛАБУС ДИСЦИПЛІНИ «Моделі ризик-менеджменту»

Ступінь вищої освіти – Магістр
Спеціальність 051 ЕКОНОМІКА
Освітня програма «Економічна кібернетика»
Рік навчання 1, семестр 1
Форма навчання денна
Кількість кредитів ЄКТС 6
Мова викладання: українська

Лектор курсу

**Контактна інформація
лектора (e-mail)**

Сторінка курсу в eLearn

Негрей Марина Володимирівна, к.е.н., доцент
Кафедра економічної кібернетики,
корпус. 15, к.221, тел. 5278567
e-mail marina.nehrey@nubip.edu.ua

ЕНК <https://elearn.nubip.edu.ua/course/view.php?id=1499>

ОПИС ДИСЦИПЛІНИ

Дисципліна «Моделі ризик-менеджменту» передбачає оволодіння студентами теоретико-методологічними та практичними навичками здійснення ідентифікації, аналізу, вимірювання, моделювання процесів управління економічними ризиками. Передбачається засвоєння методології проведення аналізу, застосування економіко-математичних моделей, що враховують ризик; набуття досвіду найбільш типових прийомів моделювання та вимірювання ризику в процесі прийняття рішень, побудови системи управління економічними ризиками.

В результаті вивчення дисципліни студент набуває здібностей: приймати ефективні рішення за невизначених умов і вимог, що потребують застосування нових підходів, методів та інструментарію соціально-економічних досліджень; оцінювати можливі ризики, соціально-економічні наслідки управлінських рішень.

СТРУКТУРА КУРСУ

Тема	Години *	Результати навчання	Завдання**	Оцінювання
Змістовий модуль 1. Основи аналітичної роботи з R				
Тема 1. Сутність ризик-менеджменту та базові методи оцінки ризиків.	6/10/13	Знати теоретичні основи ризик-менеджменту, сутність і визначення ризику та невизначеності. Розрізняти аспекти ризику. Розуміти задачі та процес управління ризиками. Знати інструменти та методи оцінки ризиків. Аналізувати економічний ефект системи ризик-менеджменту.	Виконання лабораторної роботи Виконання самостійної роботи	10 15
Тема 2. Ризик-менеджмент організації	6/10/14	Знати основи багатомірного управління організацією на принципах ризик-менеджменту. Розуміти принципи ризик-менеджменту. Аналізувати стан розвитку організації з урахуванням ризиків. Розрізняти функції управління ризиками. Знати стандарт ISO 31000. Вміти будувати концепцію ризик-менеджменту.	Виконання лабораторної роботи Виконання самостійної роботи	15 20
Тема 3. Моделювання невизначеності у ризик-менеджменті	8/10/13	Розрізняти стратегічні ризики у господарській діяльності. Аналізувати ступень ризику. Знати принципи інформаційного забезпечення процесів управління ризиками. Визначати чинники ризиків. Проводити якісний та кількісний аналіз ризиків економічних систем. Застосовувати метод VAR-аналізу ризиків.	Виконання лабораторної роботи Виконання самостійної роботи	10 20

Модульний контроль			Підсумковий тест в ЕНК	10
Підсумковий рейтинг за змістовний модуль 1				100
Змістовний модуль 2. Аналітичні інструменти з мовою програмування R				
Тема 4. Моделі ризиків фінансових активів	8/10/13	Знати особливості системи менеджменту фінансових ризиків. Розрізняти фінансові ризики та методи визначення їх рівня. Застосовувати моделі прибутковості та ризиків фінансових активів. Аналізувати інвестиційні ризики. Застосовувати методи оптимізації фінансових ризиків. Розрізняти фінансові ризики та їх джерела у бізнес-плануванні.	Виконання лабораторної роботи	15
			Виконання самостійної роботи	10
Тема 5. Моделювання ризиків у страхуванні	6/10/14	Розуміти принцип еквівалентності зобов'язань сторін у страховій діяльності. Проводити розрахунок навантаження та бруто-ставки у страхуванні. Застосовувати задачі актуарія для страхової компанії. Аналізувати ризик страховика і визначати шляхи його зниження. Вміти застосовувати кількісні методи розв'язки актуарних задач	Виконання лабораторної роботи	15
			Виконання самостійної роботи	20
Тема 6. Моделювання ризиків аграрного сектору	6/10/13	Знати типові моделі оцінці ризиків в аграрному секторі. Розрізняти джерела аграрних ризику. Розуміти організаційні заходи ризик-менеджменту в аграрному секторі. Вміти моделювати виробничі, маркетингові, фінансові, правові ризики та ризик управління персоналом в аграрній сфері.	Виконання лабораторної роботи	15
			Виконання самостійної роботи	15
Модульний контроль			Підсумковий тест в ЕНК	10
Підсумковий рейтинг за змістовний модуль 2				100
Всього за семестр				70
Екзамен			Тест, 2 задачі	30
Всього за курс				100

* лекції / лабораторні, практичні, семінарські / самостійні роботи

** Неформальна on-line освіта на основі MBOK Coursera.org та Stepik.org може бути зарахована як результат виконання самостійних робіт

ПОЛІТИКА ОЦІНЮВАННЯ

Політика щодо дедлайнів та перескладання:	Дедлайни визначені в ЕНК. Роботи, які здаються із порушенням термінів без поважних причин, оцінюються на нижчу оцінку. Перескладання модулів відбувається із дозволу лектора за наявності поважних причин (наприклад, лікарняний).
Політика щодо академічної доброчесності:	Списування під час самостійних робіт, тестування та екзаменів заборонені (в т.ч. із використанням мобільних девайсів).
Політика щодо відвідування:	Відвідування занять є обов'язковим. За об'єктивних причин (наприклад, хвороба, міжнародне стажування) навчання може відбуватись індивідуально (в дистанційній on-line формі за погодженням із деканом факультету)

ШКАЛА ОЦІНЮВАННЯ СТУДЕНТІВ

Рейтинг здобувача вищої освіти, бали	Оцінка національна за результати складання екзаменів заліків	
	Екзаменів	Заліків
90-100	Відмінно	зараховано
74-89	Добре	
60-73	Задовільно	
0-59	незадовільно	не зараховано