



СИЛАБУС ДИСЦИПЛІНИ «Ризикологія»

Ступінь вищої освіти – Бакалавр
Спеціальність 051 ЕКОНОМІКА
Освітня програма «Економічна кібернетика»
Рік навчання 3, семестр 5
Форма навчання денна
Кількість кредитів ЄКТС 4
Мова викладання: українська

Лектор курсу

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

Контактна інформація
лектора (e-mail)

Сторінка курсу в eLearn

ЕНК <https://elearn.nubip.edu.ua/course/view.php?id=291>

ОПИС ДИСЦИПЛІНИ

Дисципліна «Ризикологія» передбачає постановку задач, що пов'язані з кількісною оцінкою ризиків економічних систем. Розглядаються: функція особистої корисності; кількісні характеристики оцінки ступеню ризику; ігрові методи прийняття рішень в умовах невизначеності. Наведені приклади розв'язування конфліктних ситуацій за допомогою ігрових методів. Представлені фундаментальні співвідношення ризику та прибутковості, зокрема, для окремих інструментів фінансового ринку. Специфічні аграрні ризики та ризики цифрової економіки.

У результаті вивчення дисципліни студент набуває здібностей: застосовувати набуті теоретичні знання для розв'язання практичних завдань та змістовно інтерпретувати отримані результати.

СТРУКТУРА КУРСУ

Тема	Годин и*	Результати навчання	Завдання**	Оцінюв ання
Змістовий модуль 1. Сутнісна характеристика та методи оцінки економічних ризиків				
Тема 1. Ризик як економічна категорія. Його сутність.	6/5/7	Розрізняти види ризиків; поняття ризику та невизначеності. Знати об'єкт, суб'єкт та джерело ризику. Аналізувати причини виникнення економічного ризику, невизначеності та елементи їх класифікації. Розуміти загальні засади класифікації ризиків. Знати історію виникнення теорії ризикології.	Тест у ЕНК Виконання лабораторної роботи Виконання самостійної роботи	2 12 15
Тема 2. Методи аналізу ризику.	6/5/7	Розрізняти основні види методів аналізу ризику. Знати принципи статистичного методу аналізу ризику. Розрізняти сфери застосування аналогового та експертного методу аналізу ризику. Використовувати методи аналізу чутливості, сценаріїв та імітаційного моделювання. Знати сутність методу Монте-Карло.	Тест у ЕНК Виконання лабораторної роботи Виконання самостійної роботи	2 12 15
Тема 3. Система кількісних оцінок економічного ризику.	6/5/8	Знати загальні підходи до аналізу кількісних оцінок ризику. Проводити аналіз ступеня ризику в абсолютному та відносному виразі. Розуміти сферу застосування нерівності Чебишева та правила „трех сігм”. Розрізняти поняття	Тест у ЕНК Виконання лабораторної роботи	2 12 15

		допустимого, критичного та катастрофічного ризиків. Визначати переваги кількісного аналізу ризику.	Виконання самостійної роботи	
Модульний контроль			Підсумковий тест в ЕНК	13
Підсумковий рейтинг за змістовний модуль 1				100
Змістовний модуль 2. Аналіз та управління економічними ризиками				
Тема 4. Основні засади теорії портфеля в умовах ризику та диверсифікація як спосіб зниження ризику.	4/5/8	Розуміти сутність управління портфелем цінних паперів та диверсифікації. Розрізняти системний та специфічний ризик інвестиційного активу. Визначати кореляцію цінних паперів формувати оптимальний портфель. Знати особливості застосування моделі Марковица та Шарпа.	Тест у ЕНК Виконання лабораторної роботи Виконання самостійної роботи	2 12 15
Тема 5. Теорія корисності та прийняття рішень в умовах ризику	4/5/8	Знати основні засади теорії корисності. Розуміти поняття корисності за фон Нейманом, лотереї, сподіваного виграшу, детермінованого еквіваленту та премії за ризик, схильності, несхильності та нейтральності до ризику. Застосовувати функції корисності осіб з різним ставленням до ризику.	Тест у ЕНК Виконання лабораторної роботи Виконання самостійної роботи	2 12 15
Тема 6. Моделювання економічного ризику та теорії гри	4/5/8	Знати основні поняття гри. Розуміти сутність статичних ігор в умовах ризику та невизначеності. Розрізняти критерії прийняття рішень для різних інформаційних ситуацій. Використовувати принципи теорії ігор в економіці.	Тест у ЕНК Виконання лабораторної роботи Виконання самостійної роботи	2 12 15
Модульний контроль			Підсумковий тест в ЕНК	13
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 МВОК 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