



## СИЛАБУС ДИСЦИПЛІНИ «Ризик-менеджмент»

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

Лектор курсу

Негрей Марина Володимирівна, к.е.н., доцент  
Кафедра економічної кібернетики,  
корпус. 15, к.221, тел. 5278567

Контактна інформація  
лектора (e-mail)

e-mail [marina.nehrey@nubip.edu.ua](mailto:marina.nehrey@nubip.edu.ua)

[Портфоліо](#)

Сторінка курсу в eLearn

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

### ОПИС ДИСЦИПЛІНИ

**Мета вивчення курсу** – оволодіння студентами теоретико-методологічними та практичними навичками здійснення ідентифікації, аналізу, вимірювання, моделювання систем управління економічними ризиками.

**Завдання вивчення курсу** – набуття знань про якісні властивості та кількісні характеристики економічних процесів з урахуванням ризику – характерного чинника сучасної економіки; опанування методологією та методикою побудови, аналізу та застосування економіко-математичних моделей, що враховують ризик; вивчення низки найбільш типових прийомів моделювання та вимірювання економічного ризику у процесі прийняття рішень, опанування відповідним апаратом.

**Навчальна дисципліна забезпечує формування ряду фахових компетентностей:**

**загальні компетентності (ЗК):**

ЗК11. Здатність приймати обґрунтовані рішення.

**фахові (спеціальні) компетентності (СК):**

СК9. Здатність прогнозувати на основі стандартних теоретичних та економетричних моделей соціально-економічні процеси.

СК11. Здатність обґрунтовувати економічні рішення на основі розуміння закономірностей економічних систем і процесів та із застосуванням сучасного методичного інструментарію.

СК14. Здатність поглиблено аналізувати проблеми і явища в одній або декількох професійних сферах з врахуванням економічних ризиків та можливих соціально-економічних наслідків.

СК16. Здатність аналізувати та моделювати оцінку економічного ризику для різних професійних сфер та видів економічної діяльності.

У результаті вивчення навчальної дисципліни студент повинен показати певні **програмні результати**, а саме:

ПР12. Застосовувати набуті теоретичні знання для розв'язання практичних завдань та змістовно інтерпретувати отримані результати.

ПР13. Ідентифікувати джерела та розуміти методологію визначення і методи отримання соціально-економічних даних, збирати та аналізувати необхідну інформацію, розраховувати економічні та соціальні показники.

ПР17. Виконувати міждисциплінарний аналіз соціально-економічних явищ і проблем в одній або декількох професійних сферах з врахуванням ризиків та можливих соціально-економічних наслідків.

ПР22. Демонструвати гнучкість та адаптивність у нових ситуаціях, у роботі із новими об'єктами, та у невизначених умовах.

Дисципліна «Ризик-менеджмент» 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

Назви змістових модулів і тем	Кількість годин					
	Усього	у тому числі				
		л	п	лаб.	інд.	с. р.
<b>1</b>	<b>2</b>	<b>3</b>	<b>4</b>	<b>5</b>	<b>6</b>	<b>7</b>
<b>Змістовий модуль 1. Сутнісна характеристика та методи оцінки економічних ризиків</b>						
Тема 1. Ризик як економічна категорія. Його сутність.	25	5		5		15
Тема 2. Методи аналізу ризику.	25	5		5		15
Тема 3. Система кількісних оцінок економічного ризику.	25	5		5		15
Разом за змістовим модулем 1	75	15		15		45
<b>Змістовий модуль 2. Моделювання економічного ризику</b>						
Тема 4. Основні засади теорії портфеля в умовах ризику та диверсифікація як спосіб зниження ризику.	25	5		5		15
Тема 5. Теорія корисності та прийняття рішень в умовах ризику	25	5		5		15
Тема 6. Моделювання економічного ризику та теорії гри	25	5		5		15
Разом за змістовим модулем 2	75	15		15		45
<b>Усього годин</b>	<b>150</b>	<b>30</b>		<b>30</b>		<b>90</b>

\* 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

<b>Політика щодо дедлайнів та перекладання:</b>	Дедлайни визначені в ЕНК. Роботи, які здаються із порушенням термінів без поважних причин, оцінюються на нижчу оцінку. Перекладання модулів відбувається із дозволу лектора за наявності поважних причин (наприклад, лікарняний).
<b>Політика щодо академічної доброчесності:</b>	Списування під час самостійних робіт, тестування та екзаменів заборонені (в т.ч. із використанням мобільних девайсів).
<b>Політика щодо відвідування:</b>	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