



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 5
Мова викладання: українська

Лектор курсу

Наконечна Катерина Віталіївна, к.е.н., доцент
<https://elearn.nubip.edu.ua/course/view.php?id=2374>

Контактна інформація
лектора (e-mail)

Кафедра економічної кібернетики,
корпус. 15, к.221, тел. 5278567
e-mail nakonechna@nubip.edu.ua

Сторінка курсу в eLearn

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

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.

СТРУКТУРА КУРСУ

Тема	Години*	Результати навчання	Завдання**	Оцінювання
Змістовий модуль 1. Сутнісна характеристика та методи оцінки економічних ризиків				
Тема 1. Ризик як економічна категорія. Його сутність.	4/5/15	Сутність ризику. Складові економічного ризику. Функції та джерела економічного ризику. Класифікація ризиків. Чинники що зумовлюють необхідність проблем, пов'язаних з ризиком.	Виконання лабораторної роботи Виконання самостійної роботи	20 10
Тема 2. Методи аналізу ризику.	4/5/15	Основні методи аналізу ризиків. Методики визначення ризику проекту. Ринковий ризик. Визначення точки безбитковості. Дерево рішень.	Виконання лабораторної роботи Виконання самостійної роботи	20 10
Тема 3. Система кількісних оцінок економічного ризику.	6/5/15	Загальні підходи до кількісної оцінки ступеня ризику. Ймовірність як один з підходів до оцінки ризику. Допустимий, критичний та катастрофічний ризики. Ризик в абсолютному вираженні. Ризик у відносному вираженні.	Виконання лабораторної роботи Виконання самостійної роботи	20 10
Модульний контроль			Підсумковий тест в ЕНК	10
Підсумковий рейтинг за змістовий модуль 1				100
Змістовий модуль 2. Моделювання економічного ризику				
Тема 4. Основні	4/5/15	Поняття про диверсифікацію, норму	Виконання	20

Тема	Години*	Результати навчання	Завдання**	Оцінювання
засади теорії портфеля в умовах ризику та диверсифікація як спосіб зниження ризику.		прибутку і ризик цінних паперів. Оптимізація пакету з двох різних видів акцій. Портфель з багатьох акцій. Загальні засади теорії портфеля, оптимізація його структури. Спрощена класична модель формування портфеля.	лабораторної роботи Виконання самостійної роботи	10
Тема 5. Теорія корисності та прийняття рішень в умовах ризику	4/5/15	Теоретичні основи вибору альтернатив. Загальні аспекти прийняття рішень. Бінарні відношення та механізми прийняття рішень. Моделі та методи прийняття рішень за умови Багатокритерійності. Прийняття рішень методом аналітичної ієрархії. Моделі та методи прийняття рішень в умовах нечіткої інформації, невизначеності та ризику.	Виконання лабораторної роботи Виконання самостійної роботи	20 10
Тема 6. Моделювання економічного ризику та теорії гри	6/5/15	Урахування об'єктивно-суб'єктивної структури ризику в моделюванні економічних систем. Моделювання безпеки та розвитку економічних систем на підґрунті інструментарію теорії гри.	Виконання лабораторної роботи Виконання самостійної роботи	20 10
Модульний контроль			Підсумковий тест в ЕНК	10
Підсумковий рейтинг за змістовний модуль 2				100
Всього за семестр: (100*0,5 + 100*0,5) * 0,7				70
Екзамен			Тест, 2 задачі	30
Всього за курс				150

* лекції / лабораторні, практичні, семінарські / самостійні роботи

** Неформальна on-line освіта на основі MBOK Coursera.org та Stepiк.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