



СИЛАБУС ДИСЦИПЛІНИ
« Економічні і фінансові ризики »

Ступінь вищої освіти - Бакалавр

Спеціальність 072 Фінанси, банківська справа та страхування

Освітня програма «Фінанси і кредит»

Рік навчання 7, семестр 7

Форма навчання денна (денна, заочна)

Кількість кредитів ЄКТС 4

Мова викладання українська (українська, англійська, німецька)

Лектор курсу
Контактна інформація
лектора (e-mail)
Сторінка курсу в eLearn

Доцент Мірзоєва Тетяна Володимирівна

mirzoeva2018@ukr.net

<https://elearn.nubip.edu.ua/course/view.php?id=4130>

ОПИС ДИСЦИПЛІНИ

(до 1000 друкованих знаків)

Вивчення дисципліни направлене на формування знань щодо опанування теоретичних і методичних основ ідентифікації ризику та управління ним; набуття практичних навичок вимірювання ступеня ризику й вибору способу його зниження; засвоєння практичних підходів щодо аналізу ризику та управління ним; оволодіння навичками самостійно здійснювати аналіз, ідентифікації та оцінювання ризику.

СТРУКТУРА КУРСУ

Тема	Години (лекції/ семінарські)	Результати навчання	Завдання	Оціню- вання
1 семестр				
Модуль 1				
Тема 1. Економічна сутність і значення ризиків	2/2	Розуміти сутність ризику та причини його виникнення. Розрізняти економічний ризик та його види. Володіти класифікацією ризиків. Аналізувати види втрат, які можуть виникати внаслідок настання ризикової ситуації. Знати основні актори ризику.	Підготовка доповідей/презентацій, навчальні групові дискусії, робота з кросвордами, виконання самостійної роботи (у т.ч. в elearn).	8 балів
Тема 2. Якісне та кількісне оцінювання підприємницьких ризиків	2/2	Розуміти призначення і знати послідовність аналізу ризику. Володіти принципами аналізу ризику. Розрізняти кількісний і якісний аналіз підприємницьких ризиків. Вміти оперувати показниками абсолютного та відносного вимірювання ризику. Розуміти переваги й недоліки основних методів кількісного та якісного оцінювання ризиків.	Підготовка доповідей/презентацій, навчальні групові дискусії, робота з кросвордами, виконання самостійної роботи (в.т.ч. в elearn).	10 балів
Тема 3. Ризик та елементи теорії корисності	1/1	Розуміти сутність теорії корисності в системі процесів прийняття рішень. Розуміти сутність аксіоми раціональної поведінки, лотереї, її детермінованого еквіваленту, премії за ризик та страхової суми.	Написання тестів, навчальні групові дискусії, робота з кросвордами, виконання самостійної роботи на прикладі умовних аналітичних ситуацій.	8 балів

		Володіти методикою побудови функції користності.		
Тема 4. Методи аналізу і моделювання ризику	2/2	Вміти використовувати основні методи аналізу і моделювання ризику: статистичний метод, метод експертних оцінок, аналітичний метод, метод чутливості моделі, метод аналогів, метод аналізу доцільності витрат, метод відносних величин.	Підготовка доповідей/презентацій, навчальні групові дискусії, робота з кросвордами, розв'язок задач, підготовка презентацій.	10 балів
Модуль 2				
Тема 5. Невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності	2/2	Розуміти особливості функціонування підприємств за умов невизначеності. Знати у чому полягає сутність невизначеності та основні причини її появи. Знати видову класифікацію невизначеності. Знати механізм врахування чинника невизначеності в управлінні підприємством і засоби її зниження	Підготовка доповідей/презентацій, виконання ситуаційних завдань, робота з кросвордами, виконання самостійної роботи	8 балів
Тема 6. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності та ризику	2/2	Знати та вміти оперувати основними критеріями прийняття рішень в умовах невизначеності та ризику: правило Байеса (критерій математичного сподівання). Критерій Лапласа. Правило максимакс (критерій оптимізму). Правило максимін (критерій Вальда). Правило мінімакс (критерій Севіджа). Критерій Гурвіца (критерій песимізму-оптимізму). Критерій середнього значення і стандартного відхилення. Критерій Бернуллі.	Навчальні групові дискусії, робота з кросвордами, розв'язок задач, підготовка доповідей/презентацій, Здача практичної роботи (в.т.ч. в elearn) .	8 балів
Тема 7. Управління ризиками	2/2	Розуміти сутність ризик-менеджменту. Знати структурну схему ризик-менеджменту, функції керованої та керуючої підсистем управління ризиками, етапи процесу управління ризиками господарської діяльності на підприємстві та характеризувати їх. Володіти основними засадами формування стратегії управління ризиком.	Підготовка доповідей /рефератів/презентацій розв'язок задач. Здача практичної роботи	10 балів
Тема 8. Мінімізація економічних ризиків	2/2	Знати основні засоби впливу на ризик, прийоми зниження ступеня ризику. Розрізняти організаційні та економічні методи зниження ступеня ризику. Визначати доцільність застосування певного прийому чи методу у тій або іншій ризиковій ситуації, вміти аналізувати ефективність їх застосування.	Підготовка доповідей/презентацій, виконання ситуаційних завдань, розв'язок задач, Здача практичної роботи.	8 балів
Всього за 1 семестр				70
Екзамен				30
Всього за курс				100

ПОЛІТИКА ОЦІНЮВАННЯ

<i>Політика щодо дедлайнів та перескладання:</i>	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).
<i>Політика щодо академічної доброчесності:</i>	Списування під час контрольних робіт та екзаменів заборонені (в т.ч. із використанням мобільних девайсів). Курсові роботи, реферати повинні мати коректні текстові посилання на використану літературу
<i>Політика щодо відвідування:</i>	Відвідування занять є обов'язковим. За об'єктивних причин (наприклад, хвороба, міжнародне стажування) навчання може відбуватись індивідуально (в он-лайн 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