

АНОТАЦІЯ ЗМІСТУ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Економічні ризики та методи їх вимірювання

(назва навчальної дисципліни)

Нормативна

(нормативна/вибіркова)

Цикл професійної та практичної підготовки

(цикл дисциплін за навчальним планом)

Предмет навчальної дисципліни

Предметом навчальної дисципліни є теоретичні і практичні питання аналізу економічного ризику, математичні методи і моделювання поведінки економічних систем з урахуванням ризику.

Мета навчальної дисципліни

Метою навчальної дисципліни є фундаментальне навчання майбутніх фахівців з економіки та фінансів систематизованими знаннями щодо аналізу, моделювання та управління економічним ризиком, стратегією та тактикою антикризового управління економічним об'єктом в реальних умовах, навчити приймати оптимальні рішення в ситуаціях невизначеності та конфліктності. виробити у майбутніх фахівців розуміння суті економічних явищ і процесів.

Основні завдання

- набуття навичок щодо оцінки та аналізу ступеня ризикованості прийняття управлінських рішень для забезпечення ефективного управління підприємством, що функціонує в умовах нестабільного зовнішнього середовища;
- вироблення у майбутніх фахівців глибокого розуміння суті економічних явищ і процесів;
- гнучкого професійного мислення, оволодіння сучасною, що враховує ризик, методологією аналізу та прийняття раціональних рішень, стратегією і тактикою антикризового управління економічним об'єктом в реальних умовах.

Місце навчальної дисципліни в структурно-логічній схемі підготовки бакалаврів

Дисципліна «Економічні ризики та методи їх вимірювання» взаємопов'язана з такими дисциплінами як «Макроекономіка», «Мікроекономіка», «Інформатика», «Оптимізаційні методи та моделі», «Економіко-математичне моделювання».

Вимоги до знань і умінь

а) знати

- джерело, об'єкт і суб'єкт ризику;
- основні категорії економічного ризику;
- принципи керування економічними ризиками;
- класифікацію видів ризику;
- загальні та специфічні методи виміру ризику; кількісні та якісні, а також абсолютні і відносні оцінки ризику;
- критерії вибору управлінських рішень в умовах ризику;
- методи зниження економічного ризику;
- основні наукові підходи та сучасні концепції ризикології;
- проблеми застосування теоретичних розробок ризикології до українського ринку;
- можливості використання ризикології при прийнятті рішень в умовах невизначеності;
- пріоритетні дослідження українських науковців-ризикологів;

б) уміти

- здійснювати якісний і кількісний аналіз ризику проектів;
- розробляти заходи для оптимізації і управління ризиком;
- визначати вид ризику, що впливає на прийняття конкретного управлінського рішення;
- кількісно оцінювати вплив ризику за допомогою економіко-математичних методів;
- приймати оптимальні управлінські рішення з використанням різноманітних критеріїв теорії ігор;
- застосовувати ризикологію для формування портфеля цінних паперів, "валютного кошика", управління ризиком у менеджменті;
- розробляти й вирішувати актуальні питання теорії і практики підприємницької діяльності в умовах ризику;
- застосовувати знання з ризикології в практичній діяльності.

Зміст навчальної дисципліни за темами

Номер теми	Назва теми
Тема 1.	Ризик як економічна категорія ринкової економіки. Концептуальні засади ризикології в економіці та підприємстві.
Тема 2.	Диверсифікація ризику при прийнятті рішень на різних рівнях економічного управління
Тема 3.	Загальні методи вимірювання ризику
Тема 4.	Теорія корисності та прийняття рішень в умовах ризику
Тема 5.	Система кількісних оцінок економічного ризику

Тема 6.	Оцінка ризику з використанням апарату марківських випадкових процесів
Тема 7.	Прийняття рішень із застосуванням дерева рішень
Тема 8.	Ризик і теорія ігор. Експертні оцінки виміру ризику

Викладач

(підпис)

Шевчук І. Б.

Розглянуто і схвалено на засіданні кафедри економічної кібернетики.
Протокол № 1 від “27” серпня 2018 року.

В. о. завідувача кафедри
економічної кібернетики

(підпис)

Шевчук І. Б.