

РИЗИКОЛОГІЯ

1. Мета, основні завдання та предмет дисципліни.

Мета: формування систематизованих теоретичних і практичних знань щодо аналізу, моделювання та управління ризиком.

Завдання: надання знань про якісні та кількісні характеристики економічних процесів з урахуванням ризику; опанування методами побудови, аналізу і застосування економіко-математичних моделей з урахуванням ризику.

Предмет: економічний ризик, методологічні й методичні засади та інструментарій математичного моделювання, кількісного аналізу та управління економічним ризиком та економіко-математичні моделі економічних систем, обтяжених ризиком.

2. Програмні компетентності. В процесі опанування дисципліни здобувач вищої освіти набуває такі:

загальні компетентності:

- здатності до абстрактного мислення, аналізу та синтезу;
- здатності застосовувати знання у практичних ситуаціях;
- здатність до пошуку, оброблення та аналізу інформації з різних джерел;
- здатність до адаптації та дії в новій ситуації;
- здатності приймати обґрунтовані рішення;

спеціальні (фахові) компетентності:

- здатність пояснювати економічні та соціальні процеси і явища на основі теоретичних моделей, аналізувати і змістовно інтерпретувати отримані результати;
- здатність застосовувати економіко-математичні методи та моделі для вирішення економічних задач;
- здатність застосовувати комп'ютерні технології та програмне забезпечення з обробки даних для вирішення економічних завдань, аналізу інформації та підготовки аналітичних звітів;
- здатність прогнозувати на основі стандартних теоретичних та економетричних моделей соціально- економічні процеси;
- здатність самостійно виявляти проблеми економічного характеру при аналізі конкретних ситуацій, пропонувати способи їх вирішення.

3. Тематичний план дисципліни.

ТЕМА 1. Вступ. Концептуальні засади ризикології

ТЕМА 2. Засади системного аналізу ризику в спектрі економічних проблем.

Якісний аналіз ризику

ТЕМА 3. Основні підходи щодо кількісного аналізу ризику

ТЕМА 4. Методологічні засади та інструментарій кількісної оцінки ризику

ТЕМА 5. Ризик та елементи теорії корисності

ТЕМА 6. Основні засади та способи управління економічним ризиком

ТЕМА 7. Запаси та резерви як способи зниження ступеня ризику

ТЕМА 8. Диверсифікація як спосіб зниження ризику: елементи теорії портфеля

ТЕМА 9. Моделювання економічного ризику

ТЕМА 10. Ієрархічні моделі оцінювання економічного ризику та обґрунтування багатоцільових рішень

4. Дисципліна викладається кафедрою економіки та управління бізнесом.

5. Викладацький склад: Паламарчук О.С., викл., Вальковець А.С., викл.

6. Основна література:

1. Стешенко О.Д. Ризикологія: Навч. Посібник. – Харків: УкрДУЗТ, 2019. – 180 с.
2. Вітлінський В. В. Аналіз, оцінка і моделювання економічного ризику / В. В. Вітлінський. – К. : ДЕМІУР, 1996. – 212 с.

3. Клебанова Т. С. Теория экономического риска : учебн. пособ. для самостоятельного изучения дисциплины / Т. С. Клебанова, Е. В. Раевна. – Х. : Издательский Дом «ИНЖЕК», 2003. – 272 с.