



Силабус навчальної дисципліни «МОДЕЛЮВАННЯ ЕКОНОМІЧНИХ РИЗИКІВ»

Галузь знань: 07 Управління та адміністрування

Спеціальність:

072 Фінанси банківська справа та страхування

Освітньо-професійна програма:

«Фінанси банківська справа та страхування»

Освітньо-професійний ступінь	Фаховий молодший бакалавр
Статус дисципліни	Вибіркова навчальна дисципліна
Форма навчання	Очна (денна)
Обсяг дисципліни, кредити ЄКТС/ загальна кількість годин	3 кредити / 90 годин
Мова викладання	Українська
Анотація дисципліни	Дисципліна «Моделювання економічних ризиків» формує уявлення про особливості сучасного економічного ризику, вивчення аспектів якого належить до фундаментальних понять сучасної економічної теорії та менеджменту. Економічна ризикологія спирається на загальну економічну теорію, системний аналіз, економіко-математичні методи і моделі і знаходить дедалі ширше практичне використання у всіх сферах економічної діяльності.
Що буде вивчатися (предмет навчання)	Основні поняття ризику в економічній діяльності; для чого необхідно володіти інформацією про об'єктивність, суб'єктивність та причини виникнення ризикових ситуацій; якісний та кількісний аналіз ризику, аналіз кількісних показників ризику, моделювання ризикових ситуацій та застосування на практиці основних підходів до урахування ризику та управління ним при прийнятті рішення при економічній діяльності.
Чому це цікаво/потрібно вивчати (мета)	Ознайомлення з основними поняттями та положеннями теорії має показати що при економічній діяльності не обов'язково рухатись на осліп, використовуючи лише свій досвід та інтуїцію; робота стане набагато ефективнішою, якщо застосовувати методіку та математичний апарат для якісної оцінки ризику на практиці – це універсальний інструмент, що дозволить знизити можливість помилок при прийнятті управлінських рішень. Для цього є необхідним ознайомитись з основними поняттями та методами ризикології; виробити навички математичного дослідження економічних процесів; прищепити студентам уміння самостійно вивчати навчальну літературу; дати необхідну математичну підготовку та знання для вивчення інших дисциплін професійного спрямування, де застосовуються математичні моделі та методи для дослідження фахових питань.

Чому можна навчитися (результати навчання)	Після опанування основними поняттями студент буде знати роль дисципліни в системі дисциплін економічного циклу; прийоми розв'язку економічних задач; математичний апарат, що дозволяє ефективно вирішувати економічні задачі та створювати на їх основі математичні моделі; основні поняття та визначення: теоретико-ігрові моделі економічного ризику, якісний та кількісний аналіз економічного ризику, багатокритеріальні ігрові моделі, врахування ризиків при управлінні. Студент буде вміти: використовувати вивчені поняття та методи для розв'язування задач; обирати оптимальний метод розв'язування конкретної задачі; здійснювати аналіз та перевірку отриманого розв'язку.
Як можна користуватися набутими знаннями і уміннями (компетентності)	Розуміння ролі інформації в житті людини і життєдіяльності суспільства; знання основних трактувань феномену інформації, зокрема математичної і її впливу на формування сучасної картини світу; уміння враховувати закономірності перебігу математичних та комп'ютерних процесів у своїй діяльності; володіння навичками аналізу й оцінки математичної інформації з позицій її властивостей, практичної і особистої значущості. Розуміння суті інформаційного підходу при дослідженні математичних та комп'ютерних інформаційних процесів; знання основних етапів системно-інформаційного аналізу; володіння основними інтелектуальними операціями, такими як аналіз, порівняння, узагальнення, синтез, формалізація інформації, виявлення причинно-наслідкових зв'язків та ін.; сформованість певного рівня системно-аналітичного, логіко-комбінаторного і алгоритмічного стилів мислення; уміння генерувати ідеї й визначати засоби, необхідні для їх реалізації. Ставлення до мов (природних, формалізованих і формальних) як до засобу комунікації; розуміння особливостей використання формальних мов; знання сучасних засобів комунікації й найважливіших характеристик каналів зв'язку; володіння основними засобами телекомунікацій; знання етичних норм спілкування і основних положень правової інформаційної діяльності. Розуміння суті технологічного підходу до організації математичної та комп'ютерної діяльності; знання особливостей автоматизованих технологій комп'ютерної інформаційної діяльності; уміння виявляти основні етапи й операції в технології розв'язання математичних та комп'ютерних задач, зокрема, за допомогою засобів автоматизації; володіння навичками виконання уніфікованих операцій, що становлять основу різних інформаційних технологій. Розуміння принципів роботи, можливостей і обмежень технічних пристроїв, призначених для автоматизованої обробки математичної та комп'ютерної інформації; знання відмінностей автоматизованого і автоматичного виконання інформаційних процесів; уміння оцінювати клас завдань, які можуть бути вирішені з використанням конкретного технічного пристрою залежно від його основних характеристик. Розуміння необхідності турботи про збереження і примноження суспільних інформаційних ресурсів; готовність і здатність нести особисту відповідальність за достовірність поширюваної інформації; пошана прав інших і уміння відстоювати свої права в питаннях інформаційної безпеки особи.

	Розуміння закономірностей і особливостей перебігу інформаційних процесів у професійній діяльності; знання властивостей і характеристик професійно важливої інформації; знання основних типів інформаційних систем, які використовуються у професійній діяльності і володіння навичками роботи з цими системами; сформованість потреби у використанні новітніх інформаційних засобів при розв’язуванні практичних задач.
Навчальна логістика	МОДУЛЬ І Тема 1.Невизначеність, конфлікт і теоретико-ігрові моделі економічного ризику Тема 2.Якісний і кількісний аналіз економічного ризику. Тема 3. Моделювання економічного ризику. Ігрові моделі. МОДУЛЬ ІІ Тема 4. Багатоцільові та багатокритеріальні задачі. Оптимізація ризику Тема 5. Управління інвестиційною діяльністю підприємства. Формування оптимальної стратегії та портфеля цінних паперів Тема 6. Кредитний ризик. Управління запасами. Економічна безпека.
Пререквізити	Вивчення курсу спирається на знання, отримані у процесі вивчення дисциплін «Вища математика», «Економічна теорія», «Економіка підприємства», «Фінанси».
Постреквізити	Дисципліна «Моделювання економічних ризиків» є складовою циклу професійної та практичної підготовки фахового молодшого бакалавра з фінансів, банківської справи та страхування. Знання з даного курсу можуть використовуватися при вивченні інших спеціальних курсів, при написанні курсової роботи, навчальної та виробничої практик.
Рекомендована література	Основна (базова) 1. Економічний ризик: ігрові моделі: Навч. посібник / В. В. Вітлінський, П. І. Верченко, А. В. Сігал, Я. С. Наконечний; За ред. д-ра екон. наук, проф. В. В. Вітлінського. — К.: КНЕУ, 2002. — 446 с. 2. Останкова Л. А., Шевченко Н. Ю. Аналіз, моделювання та управління економічними ризиками. Навч. посіб. — К.: Центр учбової літератури, 2011. — 256 с. Допоміжна 3. Івченко І.Ю. Моделювання економічних ризиків і ризикових ситуацій. Навчальний посібник. — К.: Центр учбової літератури, 2007. — 344 с. 4. Конспект лекцій з дисципліни “Моделювання ризиків в економіці та бізнесі” для студентів спеціальності “Економічна кібернетика” всіх форм навчання / Укл. С. В. Гринчуцька — Тернопіль, ТНТУ імені І. Пулюя, 2014. 88с.

Інформаційні ресурси	1. www.liga.net/ – Ліга Бізнес Інформ; 2. www.nau.kiev.ua/ – Нормативні акти України; 3. www.bank.gov.ua/ – Сайт Національного банку України; 4. www.finmarket.info/ – Фінансовий ринок України.		
Формат та обсяг курсу	Вид занять	Кількість годин	
		5 семестр	6 семестр
	Лекції	30	28
	Практичні	30	28
	Самостійна робота	30	34
Розподіл балів, форма контролю	Форми контролю	Максимальна кількість балів	
	Модуль 1	17	
	Модуль 2	33	
	ЗАЛІК	50	
Циклова комісія	Предметна комісія загальноосвітньої підготовки		
Відділення	Економічне відділення		
Шкала оцінювання, національна та ЄКТС	Сума балів за всі види навчальної діяльності	Оцінка ЄКТС	Оцінка за національною шкалою
	90-100	A	Зараховано
	80-89	B	
	70-79	C	
	60-69	D	
	50-59	E	
	35-49	FX	Не зараховано (з можливістю повторного складання)
	0-34	F	Не зараховано (з обов’язковим повторним вивченням дисципліни)
Викладач(і)	ТЕТЯНА ІЛІВНА КРОШКА Посада: викладач Категорія: 1 кваліфікаційна категорія Педагогічне звання: – Науковий ступінь: – Вчене звання: – Профайл викладача (-ів): http://college-chnu.cv.ua/article/General.Education E-mail: t.kroshka@chnu.edu.ua		
Покликання на дисципліну (сторінка курсу в Moodle)			