

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.

Назви тем	Загальна кількість годин	У тому числі	
		Заняття з викладачем	Самостійна робота
ТЕМА 1. Вступ. Концептуальні засади ризикології	5	2	3
ТЕМА 2. Засади системного аналізу ризику в спектрі економічних проблем. Якісний аналіз ризику	7	2	5
ТЕМА 3. Основні підходи щодо кількісного аналізу ризику	12	6	6
ТЕМА 4. Методологічні засади та інструментарій кількісної оцінки ризику	12	6	6
ТЕМА 5. Ризик та елементи теорії корисності	10	4	6
ТЕМА 6. Основні засади та способи управління економічним ризиком	6	2	4
ТЕМА 7. Запаси та резерви як способи зниження ступеня ризику	8	2	6
ТЕМА 8. Диверсифікація як спосіб зниження ризику: елементи теорії портфеля	10	4	6
ТЕМА 9. Моделювання економічного ризику	10	4	6
ТЕМА 10. Ієрархічні моделі оцінювання економічного ризику та обґрунтування багатоцільових рішень	10	4	6
Усього навчальних годин	90	36	54

4. Дисципліна викладається кафедрою економічної кібернетики.

5. Викладацький склад:

Барановський С.В., к.т.н., доцент; Коханевич Т.П., викладач.

6. Основна література:

1. Ризикологія. Навчально-методичний посібник для самостійного вивчення дисципліни / Барановський С.В., Коханевич Т.П. – Рівне: РДГУ, 2018 – 39 с.
2. Лабораторний практикум з дисципліни «Ризикологія» / Барановський С.В., Коханевич Т.П. – Рівне: РДГУ, 2018 – 28с.
3. Методичні рекомендації щодо виконання лабораторних робіт та контрольної роботи з дисципліни «Ризикологія» для студентів заочної форми навчання спеціальності 051 «Економіка» спеціалізації «Економічна кібернетика» / Барановський С.В., Коханевич Т.П. – Рівне: РДГУ, 2018 – 32с.