

**ЗАХІДНОУКРАЇНСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ФАКУЛЬТЕТ КОМП'ЮТЕРНИХ ІНФОРМАЦІЙНИХ ТЕХНОЛОГІЙ
КАФЕДРА ЕКОНОМІЧНОЇ КІБЕРНЕТИКИ ТА ІНФОРМАТИКИ**

Назва курсу	«Моделі управління ризиками»
Викладач (-і)	к.е.н., доцент Башуцька Оксана Степанівна
Профайл викладача (-ів)	http://www.wunu.edu.ua/educational/subdivisions/fkit/department-eki-fkit/
Контактний тел.	+380352-475050 ext. 12 322
E-mail:	o.bashutska@wunu.edu.ua

1. Анотація до курсу. У сучасних реаліях ринкового економічного середовища діяльність суб'єктів господарювання супроводжується різними видами ризиків. Для прийняття ефективних управлінських рішень на мікро- та макрорівнях суб'єкту господарювання слід не уникати їх, а навчитись керувати ними, використовуючи розроблені у сучасній вітчизняній та зарубіжній літературі методи управління та нейтралізації ризиків, що дозволить звести до мінімуму їх рівень і водночас отримати очікуваний рівень доходу. Тому від сучасного фахівця вимагається правильно оцінити всі можливі варіанти проведення кожної конкретної господарської операції, для чого необхідно оволодіти сучасною, що враховує ризик, методологією аналізу та прийняття раціональних рішень, стратегією і тактикою антикризового управління економічним об'єктом в реальних умовах.

2. Пререквізити.

Для успішного освоєння дисципліни потрібно використовувати знання та вміння з раніше вивчених дисциплін «Системний аналіз», «Теорія імовірностей та математична статистика», «Сучасні інформаційні технології».

Постреквізити. Курс передбачає формування знань умінь та навичок прийняття управлінських рішень в умовах ризику.

3. Мета та цілі курсу.

Метою вивчення дисципліни «Моделі управління ризиками» є вивчення теоретичних основ моделювання ризиків для різних видів економічної діяльності та методів управління ризиками в умовах ринкової економіки.

Завдання вивчення дисципліни є набути навичок кількісного оцінювання ризиків у складних економічних системах.

4. Результати навчання:

1. Знати та вміти застосовувати основні методи постановки та вирішення задач системного аналізу в умовах невизначеності цілей, зовнішніх умов та конфліктів.
2. Знати основи теорії оптимізації, оптимального керування, теорії прийняття рішень в умовах ризику, вміти застосовувати їх на практиці для розв'язування прикладних задач управління і проектування складних систем.

5. Загальна інформація про дисципліну.

Ступінь вищої освіти	Магістр
Спеціальність	124 Системний аналіз
Курс (рік навчання)	1
Семестр	2
Рік викладання	
Формат курсу	Очний (<i>offline</i>)
Нормативна \ вибіркова	вибіркова
Загальна кількість год/ кредитів	150/5
Лекції, год.	30

6. Перелік тем

1. Сутність та види ризиків.
2. Організація управління ризиками.
3. Статистичні методи оцінювання ризиків.
4. Експертні методи оцінювання ризиків.
5. Теорія корисності та схильності до ризику.
6. Оцінка ризику інвестиційних проектів.
7. Основні способи регулювання ризиків.
8. Гіпотези та моделі сучасної портфельної теорії.
9. Ризики в інвестиційній діяльності.
10. Прийняття рішень в умовах ризику.
11. Практика управління ризиком.

7. Рекомендовані джерела інформації

1. Васильєва Т.А., Кривич Я.М., Леонов С.В. Економічний ризик: методи оцінки та управління : навч. посіб. Суми : ДВНЗ «УАБС НБУ», 2015. 208 с.
2. Вітлінський В.В. Ризикологія в економіці та підприємстві: монографія // Вітлінський В.В., Великоіванченко Г.І. – Київ: КНЕУ, 2004. – 480 с.
3. Артими-Дрогомирецька З. Б. Економічний ризик: Навчальний посібник. / З. Б . Артими-Дрогомирецька. - К.: Центр учбової літератури, 2013.- 316с.
4. Економіко-математичне моделювання: навчальний посібник. / За ред.. О.Т . Івашука. – Тернопіль: ТНЕУ: Економічна думка, 2008. – 704с.
5. Івченко І.Ю . Моделювання економічних ризиків і ризикових ситуацій. Навч. посібник / І.Ю . Івченко – К.: Центр учбової літератури, 2007. – 344с.
6. Шегда А.В. Ризики в підприємстві: оцінювання та управління. Навч. посібник / А.В.Шегда, М.В.Голованенко. – К.:Знання,2008. –271 с.
7. Балджи М.Д. Економічний ризик та методи його вимірювання. Навчальний посібник. – Харків: Промарт, 2015. – 300 с.
8. Кучеренко В.Р., Карпов В.А., Карпов А.В. Економічний ризик та методи його вимірювання: Навчальний посібник. – Одеса, 2017. – 200 с.
9. Старостіна А. О., Кравченко В. А. Ризик-менеджмент: теорія та практика: Навч. посіб. – К.: ІВЦ —Видавництво «Політехніка», 2004. – 200 с.
10. Посохов І.М. Управління ризиками у підприємстві: навчальний посібник \ І. М. Посохов. – Харків : НТУ «ХП», 2015. – 220 с.
11. Управління фінансовими ризиками : навч. посібник / Куцик П.О., Васильців Т.Г., Сороківський В.М., Стефаняк В.І., Сороківська М.В. – Львів : Растр-7, 2016. – 318 с.
12. Вітлінський В. В. Економічний ризик : ігрові моделі : Навч. посібник / В. В. Вітлінський, П. І. Верченко, А. В. Сігал, Я. С. Наконечний.– К. : КНЕУ, 2002.– 446 с.
13. Amitabh Bhargava. Credit Risk Management Systems In Banks. — ICID. Feb 10, 2016.
14. Beck U.Risk Society. Towards a New Moderning. London, 2002. 298 p.

8. Система оцінювання та вимоги.

Підсумковий бал (за 100-бальною шкалою) з дисципліни Дослідження операцій визначається як середньозважена величина, в залежності від питомої ваги кожної складової залікового кредиту:

Заліковий модуль 1	Заліковий модуль 2	Заліковий модуль 3	Разом
30%	40%	30%	
1. Усне опитування під час заняття (5 теми по 8 балів = 40 балів) 2. Письмова робота = 60 балів	1. Усне опитування під час заняття (6 тем по 5 балів = 30 балів) 2. Письмова робота = 70 балів	1. Написання та захист КППЗ = 80 балів. 2. Виконання завдань під час тренінгу = 20 балів	100%

Шкала оцінювання:

За шкалою Університет	За національною шкалою	За шкалою ECTS
90-100	Відмінно	A (відмінно)
85-89	Добре	B (дуже добре)
75-84		C (добре)
65-74	Задовільно	D(задовільно)
60-64		E (достатньо)
35-59	Незадовільно	FX (незадовільно з можливістю повторного складання)
1-34		F (незадовільно з обов'язковим повторним курсом)

9. Політики курсу.

Академічна доброчесність. Дотримання академічної доброчесності студентами передбачає:

- самостійне виконання навчальних завдань, завдань поточного та підсумкового контролю результатів навчання (для осіб з особливими освітніми потребами ця вимога застосовується з урахуванням їхніх індивідуальних потреб і можливостей);
- посилання на джерела інформації у разі використання ідей, розробок, тверджень, відомостей;
- дотримання норм законодавства про авторське право і суміжні права;
- надання достовірної інформації про результати власної навчальної (наукової, творчої) діяльності, використанні методики досліджень і джерела інформації.

Порушенням академічної доброчесності вважається:

- академічний плагіат - оприлюднення (частково або повністю) наукових (творчих) результатів, отриманих іншими особами, як результатів власного дослідження (творчості) та/або відтворення опублікованих текстів (оприлюднених творів мистецтва) інших авторів без зазначення авторства; самоплагіат - оприлюднення (частково або повністю) власних раніше опублікованих наукових результатів як нових наукових результатів;
- фабрикація - вигадання даних чи фактів, що використовуються в освітньому процесі або наукових дослідженнях;
- фальсифікація - свідомо зміна чи модифікація вже наявних даних, що стосуються освітнього процесу чи наукових досліджень;
- списування - виконання письмових робіт із залученням зовнішніх джерел інформації, крім дозволених для використання, зокрема під час оцінювання результатів навчання.

За порушення академічної доброчесності здобувачі освіти можуть бути притягнені до такої академічної відповідальності:

- повторне проходження оцінювання (контрольна робота, іспит, залік тощо);
- повторне проходження відповідного освітнього компонента освітньої програми.

Політика запізнення. За несвоєчасно виконані завдання буде накладено штраф 10 відсотків від загальної кількості балів за це завдання. Примітка. Виключення можуть бути зроблені до невчасно зданих завдань з поважних причин.