

**МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ТАВРІЙСЬКИЙ ДЕРЖАВНИЙ АГРОТЕХНОЛОГІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ІМЕНІ ДМИТРА МОТОРНОГО**

**Факультет економіки та бізнесу
Кафедра економіки і бізнесу**

СИЛАБУС

з навчальної дисципліни

«Економічний ризик та методи його оцінювання»

<https://op.tsatu.edu.ua/course/view.php?id=1140>

Викладач (і) к.е.н., доц. Кукіна Наталя Володимирівна
<http://www.tsatu.edu.ua/et/people/kukina-natalja-volodymyrivna/>
Кількість кредитів 5
Загальна кількість годин 150

Загальний опис навчальної дисципліни

Анотація курсу. Курс вивчає ризик як характерний феномен ринкової економіки, пізнання і свідоме використання економічних законів і закономірностей функціонування та розвитку об'єктів і суб'єктів в умовах невизначеності та конфліктності зовнішнього та внутрішнього середовища, вироблення навичок при врахуванні існуючої діалектичної об'єктивно-суб'єктивної структури ризику в процесі здійснення його якісного чи кількісного аналізу, визначення кількісної оцінки його міри і моделювання, врахування та управління ним.

Мета дисципліни – формування комплексного розуміння економіки, як складної динамічної системи взаємодії об'єктивних та суб'єктивних факторів, шляхом вивчення детермінантного впливу невизначеності та ризику на характер економічних процесів.

Завдання опанування здобувачами знань з методики дослідження економічних ризиків та практики їх якісної та кількісної оцінки в процесі господарської діяльності.

Результати навчання (компетентності)

Компетентності, які студент набере в результаті вивчення дисципліни

Спеціальність	Загальні компетентності (ЗК)	Спеціальні (фахові) компетентності (ФК)	Результати навчання (РН)
051 «Економіка» ОПП «Економічна кібернетика та	ЗК4. Здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях. ЗК8. Здатність до	ФК 06. Здатність застосовувати комп'ютерні технології та програмне забезпечення з обробки даних для вирішення економічних завдань, аналізу інформації та	РН5. Застосовувати аналітичний та методичний інструментарій для обґрунтування

програмування»	пошуку, оброблення та аналізу інформації з різних джерел. ЗК9. Здатність до адаптації та дії в новій ситуації. ЗК11. Здатність приймати обґрунтовані рішення.	підготовки аналітичних звітів.	пропозицій та прийняття управлінських рішень різними економічними агентами (індивідуумами, домогосподарствами, підприємствами та органи державної влади). РН8. Застосовувати відповідні економіко-математичні методи та моделі для вирішення економічних задач. РН10. Проводити аналіз функціонування та розвитку суб'єктів господарювання, визначати функціональні сфери, розраховувати відповідні показники, які характеризують результативність їх діяльності.
051 «Економіка» ОПП «Економічний консалтинг та бізнес-економіка»	ЗК4. Здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях. ЗК8. Здатність до пошуку, оброблення та аналізу інформації з різних джерел. ЗК9. Здатність до адаптації та дії в новій ситуації. ЗК11. Здатність приймати обґрунтовані рішення.	ФК1. Здатність виявляти знання та розуміння проблем предметної області, основ функціонування сучасної економіки на мікро-, мезо-, макро- та міжнародних рівнях. ФК4. Здатність пояснювати економічні та соціальні процеси і явища на основі теоретичних моделей, аналізувати і змістовно інтерпретувати отримані результати. ФК6. Здатність застосовувати комп'ютерні технології та програмне забезпечення з обробки даних для вирішення економічних завдань, аналізу інформації та підготовки аналітичних звітів. ФК8. Здатність аналізувати та розв'язувати завдання у сфері економічних та соціально-трудових відносин ФК11. Здатність обґрунтовувати економічні рішення на основі розуміння закономірностей економічних систем і процесів та із застосуванням сучасного методичного інструментарію. ФК12. Здатність самостійно виявляти проблеми економічного характеру при аналізі конкретних ситуацій, пропонувати способи їх вирішення. ФК13. Здатність проводити економічний аналіз функціонування та розвитку суб'єктів господарювання, оцінку їх конкурентоспроможності. ФК14. Здатність поглиблено аналізувати проблеми і явища в	РН3. Знати та використовувати економічну термінологію, пояснювати базові концепції мікро- та макроекономіки. РН4. Розуміти принципи економічної науки, особливості функціонування економічних систем. РН12. Застосовувати набуті теоретичні знання для розв'язання практичних завдань та змістовно інтерпретувати отримані результати.

		<p>одній або декількох професійних сферах з врахуванням економічних ризиків та можливих соціально-економічних наслідків.</p> <p>ФК15. Здатність створювати та оцінювати моделі економічних процесів як аналітично так і з використанням універсальних програмних засобів і аналітичних платформ, що застосовуються для аналізу даних.</p> <p>ФК17. Здатність до постановки задач кількісного аналізу та математичного моделювання процесів ринкової економіки.</p> <p>ФК18. Здатність проводити аналіз функціонування та розвитку економічних суб'єктів.</p>	
--	--	--	--

Орієнтовний перелік тем лекцій

1. Сутність ризику як економічної категорії
2. Зовнішні ризики у сучасному підприємстві
3. Внутрішні ризики у сучасному підприємстві
4. Методичні засади якісного та кількісного аналізу ризику
5. Мінімізація ризиків: основні заходи та процедури
6. Сутність і зміст управління ризиками

Орієнтовний перелік тем практичних занять

1. Обґрунтування рішень в умовах ризику та невизначеності
2. Побудова імітаційної моделі оцінки ризику проекту
3. Оцінка зовнішніх ризиків
4. Оцінка валютних ризиків
5. Складання розподілу імовірностей та розрахунок основних показників ризику
6. Аналіз ризику акцій портфеля цінних паперів
7. Аналіз чутливості параметрів моделі за допомогою коефіцієнту еластичності
8. Розрахунок коефіцієнту кореляції та ступеня ризику портфеля цінних паперів
9. Встановлення рекомендованої величини резервного фонду та ефективності страхування діяльності підприємства
10. Мінімізація ризику в теорії портфеля цінних паперів
11. Аналіз наявності фінансових резервів підвищення конкурентоздатності компанії

Політика курсу

✓ Відвідування занять є обов'язковим компонентом оцінювання. За пропуски занять без поважної причини здобувач вищої освіти буде неатестований з даної дисципліни. Усі пропущені заняття мають бути відпрацьовані під час консультацій або на Освітньому порталі університету.

- ✓ Через об'єктивні причини (наприклад, карантин, хвороба, участь у конференції, науковому проекті, міжнародному стажуванні) навчання може відбуватись в on-line формі на Освітньому порталі ТДАТУ з використанням системи Moodle або за посередництва інших інформаційно-комунікаційних платформ чи технологій за погодженням із викладачем курсу.
- ✓ Списування під час виконання контрольних заходів, диференційованого заліку та екзамену заборонені, зокрема із використанням мобільних гаджетів, комунікаційних засобів тощо.
- ✓ Презентації та виступи мають бути авторськими (оригінальними).
- ✓ Здобувач вищої освіти повинен дотримуватися академічної етики: виявляти дисциплінованість, вихованість, доброзичливість, чесність, відповідальність, дбайливо ставитись до обладнання та книжкового фонду ТДАТУ, виконувати графік освітнього процесу.

Рекомендована література

1. Верченко П. І. Ризикологія: Навч.-метод. посіб. для самост. вивч. дисц. / [Верченко П. І. Великоіваненко Г. І., Демчук Н. В. та ін.] — К.: КНЕУ, 2006. — 176 с.
2. Вітлінський В. В., Великоіваненко Г. І. Ризикологія в економіці та підприємстві: Монографія. — К.: КНЕУ, 2004. — 480 с.
3. Вітлінський В. В., Верченко П.І. КАналіз, моделювання та управління економічним ризиком: Навч.-метод. Посібник для сам ост. Вивч. Дисц. — К.: КНЕУ, 2000. — 292с.
4. Вітлінський В. В., Наконечний С. І., Шарапов О. Д. Економічний ризик і методи його вимірювання: Підручник. — К.: ІЗМН, 2000. — 252с.
5. Даниленко А. Очікувані зовнішні фактори розвитку та ризику для української економіки у 2011-2012 роках / А.Даниленко, В. Домрачев // Вісник НБУ, травень 2011. — С. 10 – 15.
6. Економічний ризик: ігрові моделі: Навч. посібник / В. В. Вітлінський, П. І. Верченко, А. В. Сігал, Я. С. Наконечний; за ред. В. В. Вітлінського. — К.: КНЕУ, 2002. — 446 с.
7. Ковальчук Н.П. Економічні ризики: класифікація, принципи і способи оцінювання / Н.П. Ковальчук // Актуальні проблеми економіки. - №10 (124). – 2011. – С. 31-37.
8. Машина Н. І. Економічний ризик і методи його вимірювання. – К.: Центр навчальної літератури, 2003. – 188 с.
9. Резнікова О.О. Проблеми стійкості України до глобальних ризиків: економічний аспект / О.О. Резнікова // Стратегічні пріоритети, №1(26). – 2013. – С. 61-65.

