

Навчальна дисципліна
“ОСНОВИ РИЗИКОЛОГІЇ”

Освітній ступінь: бакалавр

Семестр: 4

Кафедра: економічної кібернетики

Форма звітності: залік

Обсяг дисципліни:

Загальна кількість годин – 90 (кредитів ЄКТС – 3);

Аудиторні години – 32 год. (лекції – 16 год., практичні – 16 год.)

Лектор: к .е. н., доцент Артим-Дрогомирецька Зоряна Богданівна

Мета: формування знань, вмінь та навичок, необхідних для ефективного управління ризиком, комплексного аналізу та прогнозування ризику; оволодіння студентами теоретичними та практичними навичками здійснення ідентифікації, аналізу, вимірювання ризиків, моделювання систем управління ризиками.

Завдання: засвоєння методики проведення аналізу ризиків та застосування економіко-математичних моделей, що враховують ризик; набуття досвіду найбільш типових прийомів моделювання та вимірювання ризику в процесі прийняття рішень, побудови системи управління ризиками у економічній сфері.

Зміст дисципліни (перелік тем):

1. Концептуальні засади ризикології в економіці та підприємстві.
2. Системний аналіз ризику в спектрі економічних проблем. Якісний аналіз ризику.
3. Методологічні засади й інструментарій кількісного оцінювання ступеня ризику.
4. Теорія корисності та прийняття рішень в умовах ризику.
5. Основні засади теорії портфеля в умовах ризику та диверсифікація як спосіб зниження ризику.
6. Моделювання економічного ризику та теорії гри.
7. Прийняття багатоцільових рішень в умовах ризику.
8. Основні засади управління ризиком. Ризик-менеджмент.
9. Економічні ризики, пов'язані з операційною діяльністю підприємства. Фінансовий ризик-менеджмент.