

Назва. Статистичний аналіз ризиків та методи їх оцінювання

Тип. Базова.

Рік навчання. 2019–2020.

Семестр. 2.

Кількість кредитів ЄКТС. 5.

ПІБ лектора, науковий ступінь, посада. Степурина С.О. к. екон. н., доц.

Результати навчання.

здатність до цілісного уявлення про вплив ризику на діяльність вітчизняних підприємств та організацій, що функціонують у конкурентному зовнішньому оточенні;

здатність до визначення джерел виникнення економічного ризику та класифікації видів ризику, що впливають на прийняття управлінського рішення з функціонування підприємства/організації;

здатність оцінювати ризик операцій/проектів на підставі визначення корисності проектів та ймовірності настання ризику;

здатність щодо кількісної оцінки ризику за допомогою економіко-математичних методів загального характеру;

здатність приймати оптимальні управлінські рішення з використанням різноманітних критеріїв теорії ігор;

здатність щодо кількісної оцінки ризику за допомогою економіко-математичних методів спеціального характеру;

здатність розробляти управлінські заходи для зменшення впливу конкретного ризику на діяльність підприємства.

Обов'язкові попередні навчальні дисципліни. Мікроекономіка, Макроекономіка, Інформатика, Вища математика, Статистика, Економічна статистика, Менеджмент, Економіка підприємства.

Зміст. Ризик як економічна категорія ринкової економіки. Диверсифікація ризику при прийнятті рішень на різних рівнях економічного управління. Теорія корисності та прийняття рішень в умовах ризику. Система кількісних оцінок економічного ризику. Оцінка ризику з використанням апарату марківських випадкових процесів. Загальні методи вимірювання ризику. Експертні оцінки вимірювання ризику. Ризик і теорія ігор. Ризик на фінансовому ринку. Методи зниження ризику в різних сферах діяльності виробників.

Рекомендовані джерела.

1. Балабанов И.Т. Риск-менеджмент / И. Т. Балабанов. – М.: Финансы и статистика, 1996. – 156 с.

2. Бережная Е. В. Математические методы моделирования экономических систем: учебн. пособ. / Е. В. Бережная, В. И. Бережной. – М. : Финансы и статистика, 2002. – 368 с.

3. Вітлінський В. В. Аналіз, оцінка і моделювання економічного ризику / В. В. Вітлінський. – К. : ДЕМІУР, 1996. – 212 с.

4. Вітлінський В. В. Ризик у менеджменті / В. В. Вітлінський, С. І. Наконечний. – К. : ТОВ „Бори сфен–М”, 1996. – 326 с.
5. Вітлінський В. В. Ризикологія в економіці та підприємстві: Моно-графія / В. В. Вітлінський, Г. І. Великоіваненко. – К. : КНЕУ, 2002. – 490 с.
6. Гранатуров В. М. Экономический риск: сущность, методы измерения, пути снижения / В. М. Гранатуров. – М.: Изд-во «Дело и Сервис», 1999. – 112 с.
7. Клебанова Т. С. Теория экономического риска : учебн. пособ. / Т. С. Клебанова, Е. В. Раевнева. – Х. : Издательский Дом «ИНЖЕК», 2006. – 208 с.
8. Ястремський О. І. Моделювання економічного ризику / О. І. Ястремський. – К. : Либідь, 1992. – 80с.
9. Клебанова Т. С. Теория экономического риска : учебн. пособ. / Т. С. Клебанова, Е. В. Раевнева. – Х. : Изд. ХГЭУ, 2001. – 132 с.
10. Клебанова Т. С. Теория экономического риска : учебн. пособ. для самостоятельного изучения дисциплины / Т. С. Клебанова, Е. В. Раевнева. – Х. : Издательский Дом «ИНЖЕК», 2003. – 272 с.
11. Клебанова Т. С. Теория экономического риска : учебн. пособ. – 2-е изд., перераб. и доп./ Т. С. Клебанова, Е. В. Раевнева. – Х. : Издательский Дом «ИНЖЕК», 2007. – 208 с.

Методи навчання.

Проблемні лекції, міні-лекції, банки візуального супроводження та презентації. Лекційні, практичні, семінарські з використанням інформаційних технологій.

Методи оцінювання:

- поточний контроль (тестування, захист практичних робіт, оцінювання виступів на семінарських заняттях);
- модульний контроль (модульні контрольні роботи);
- підсумковий контроль (залік).

Мова навчання. Українська.