

**1. Назва.** Методи та моделі управління ризиками

**2. Шифр.** 124 «Системний аналіз»

**3. Тип.** Вибіркова

**4. Рік навчання.** 2019-2020

**5. Семестр.** VII

**6. Кількість кредитів ЄКТС - 5.**

**7. ШБ лектора, науковий ступінь, посада.**

Гур'янова Лідія Семенівна, д.е.н., проф.

**8. Результати навчання:**

здатність до обґрунтування інструментальних засобів оцінки ризику та розробки управлінських рішень в умовах ризику;

здатність до застосування сучасних методів та моделей для ідентифікації, аналізу та оцінювання ризику;

здатність до обґрунтування вибору оптимального рішення в умовах невизначеності та ризику;

здатність здійснювати оцінку проектних ризиків та визначати методи їх регулювання.

**9. Обов'язкові попередні навчальні дисципліни.**

Теорія прийняття рішень, Моделювання систем, Імітаційне моделювання.

**10. Зміст.**

Зміст ризику. Особливості управління ризиками. Поняття визначеність, ризик, невизначеність. Сутнісна характеристика ризику. Об'єкт, суб'єкт, джерело ризику. Фактори впливу на ступінь ризику. Основні напрямки політики управління ризиками. Принципи управління ризиками. Класифікація ризиків. Зміст та поняття основних видів ризиків. Історія виникнення теорій ризиків.

Обґрунтування рішень в умовах ризику. Характеристика критеріїв прийняття рішень за умов ризику. Зниження ризику за допомогою статистичної теорії прийняття рішень. Максимізація очікуваної корисності. Алгоритм побудови функцій корисності. Характеристика функції корисності по відношенню до ризику. Визначення вартості досконалої інформації.

Основні категорії ризику. Критерії ступеню ризику. Абсолютна та відносні оцінки ризику. Оцінка ризику на підставі коефіцієнту ризику.

Класифікація методів оцінки ризиків. Статистичний метод вимірювання ризику. Крива ризику. Область ризику. Аналітичний метод вимірювання ризику.

Методи експертних оцінок. Індивідуальні експертні оцінки. Колективні експертні оцінки. Методи організації та обробки результатів експертного оцінювання. Основні стадії експертного опитування. Математичні методи аналізу експертних оцінок. Аналіз рівня ризику.

Особливості прийняття рішень у конфліктних ситуаціях. Сутність теорії ігор. Система понять теорії ігор. Класифікація ігор. Ігри з противником: формальне представлення, вибір оптимальної стратегії.

Критерії обґрунтування рішень під час прийняття (вибору) проекту. Методи оцінки проектних ризиків. Сутність фінансових рішень. Теорія оптимального

портфеля. Загальне правило щодо диверсифікації. Портфелі мінімального ризику. Портфелі максимальної ефективності. Формування оптимального портфеля з обмеженої кількості фінансових інструментів.

Необхідність управління ризиками. Сутність ризик-менеджменту. Структурна схема ризик-менеджменту. Функції керованої та керуючої підсистем управління ризиками. Основні напрями й методи впливу на ступінь ризику. Уникнення та компенсація ризику. Збереження та передавання ризику. Методи зниження ризиків.

#### **11. Рекомендовані джерела.**

1. Балабанов И.Т. Риск-менеджмент. – М.: Финансы и статистика, 1996, 156с.
2. Ватник П.А. Теория риска: учеб. пособие – СПб.: СПбГИЭУ, 2009.
3. Вітлінський В. В. Аналіз, моделювання та управління ризиком : навч.-метод. посібник для самост. вивч. дисц. / В. В. Вітлінський, П. І. Верченко. – К. : КНЕУ, 2000. – 292 с.
4. Вітлінський В.В., Наконечний С.І. Ризик у менеджменті.- Київ, ТОВ “Борисфен-М”, 1996.- 326с.
5. Камінський А.Б. Ідентифікація, аналіз та управління операційними ризиками в українських банках (дослідження Агентства фінансових ініціатив) [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <http://www.afi.com.ua>
6. Клебанова Т.С. / Методы и модели прогнозирования социально-экономических процессов Учебное пособие / Клебанова Т.С., Курзенев В.А., Наумов В.Н., Гурьянова Л.С. – СПб.: Издательство СЗИУ РАНХ и ГС, 2012. – 566 с.
7. Клименко С. М. Обґрунтування рішень і оцінювання ризиків : навчальний посібн. / С. М. Клименко, О. С. Дуброва. – К. : КНЕУ, 2005. – 252 с.
8. Уотшем Т.Дж., Паррамоу К. Количественные методы в финансах: Учеб. пособие для вузов / Пер. с англ. Под ред. Ефимовой М.Р. – М.: Финансы, ЮНИТИ, 1999. – 527с.
9. Шапкин А. С. Экономические и финансовые риски : монография / А. С. Шапкин. – М. : Изд.-торг. корпорация "Дашков и Ко", 2003. – 544 с.
10. Ястремський О.І. Моделювання ризику. – Київ: Либідь, 1992. – 174 с.

#### **12. Методи навчання.**

Лекції, лабораторні/практичні заняття, лекції проблемного характеру, робота в малих групах, комп'ютерна симуляція, презентації.

#### **13. Методи оцінювання:**

- поточний контроль (активна робота на лекційних заняттях, активна участь у виконанні практичних/лабораторних завдань, проведення поточних контрольних робіт, виконання індивідуальних завдань);
- модульний контроль (комплексна контрольна робота);
- підсумковий контроль (залік).

#### **14. Мова навчання.** Українська