



Силабус навчальної дисципліни
«Статистичний аналіз ризиків та методи його оцінювання»

Спеціальність	Економіка
Освітня програма	Бізнес-статистика і аналітика
Освітній рівень	Перший (бакалаврський)
Статус дисципліни	Вибіркова
Мова викладання	Українська
Курс / семестр	3 курс, 6 семестр
Кількість кредитів ЄКТС	4
Розподіл за видами занять та годинами навчання	Лекції – 24 год. Практичні – 24 год. Самостійна робота – 72 год.
Форма підсумкового контролю	Залік
Кафедра	Статистики і економічного прогнозування, 61166, м. Харків, пр. Науки, 9а, ХНЕУ ім. С.Кузнеця, Тел. +38(057)702-18-32, сайт кафедри: https://statistics.hneu.edu.ua/
Викладач (-і)	Раєвцева Олена Валентинівна, професор, доктор економічних наук
Контактна інформація	olena.raev@gmail.com
Дні занять	Відповідно розкладу занять на 2 семестр 2020-2021 н.р.
Консультації	Відповідно до розкладу консультацій на 2 семестр 2020 - 2021 н.р.
Мета навчальної дисципліни	
придбання майбутніми фахівцями в сфері економіки компетентностей у галузі системного аналізу категорії активного ризику, оволодіння методологічними засадами, методичними підходами та інструментарієм сучасної ризикології, тобто спектром спеціальних економіко-математичних методів оцінювання та моделювання ризику	
Передумови для навчання	
Перелік попередньо прослуханих дисциплін: мікроекономіка, макроекономіка, вища математика, статистика, економічна статистика, менеджмент, економіка підприємства. Знання, вміння, навички, якими повинен володіти зі студент, щоб приступити до вивчення дисципліни: основ економіки підприємства, економічної статистики, вищої математики, економетрики та володіти навичками роботи в пакеті Microsoft Office (Word, Excel, PowerPoint).	
Зміст навчальної дисципліни	
Змістовий модуль 1. Теоретичні засади та загальний інструментарій оцінки ризику.	
Тема 1. Ризик як економічна категорія ринкової економіки.	
Тема 2. Диверсифікація ризику при прийнятті рішень на різних рівнях економічного управління.	
Тема 3. Теорія корисності та прийняття рішень в умовах ризику.	
Тема 4. Система кількісних оцінок економічного ризику.	
Тема 5. Оцінка ризику з використанням апарату марківських випадкових процесів.	
Змістовий модуль 2. Моделювання економічного ризику.	
Тема 6. Загальні методи вимірювання ризику.	
Тема 7. Експертні оцінки виміру ризику	
Тема 8. Ризик і теорія ігор	
Тема 9. Ризик на фінансовому ринку	
Тема 10. Методи зниження ризику в різних сферах діяльності виробників	
Матеріально-технічне (програмне) забезпечення дисципліни Microsoft Office (Word, Excel, PowerPoint)	
Сторінка курсу на платформі Moodle (персональна навчальна система)	https://pns.hneu.edu.ua/course/view.php?id=1057
Рекомендовані джерела	
Основні: 1. Балабанов И.Т. Риск-менеджмент / И. Т. Балабанов. – М.: Финансы и статистика, 1996. – 156 с. 2. Вітлінський В. В. Аналіз, оцінка і моделювання економічного ризику / В. В. Вітлінський. – К. : ДЕМІУР, 1996. – 212 с. 3. Вітлінський В. В. Ризик у менеджменті / В. В. Вітлінський, С. І. На-конечний. – К. : ТОВ „Бори сфен-М”, 1996. – 326 с. 4. Гранатуров В. М. Экономический риск: сущность, методы измерения, пути снижения / В. М. Гранатуров. – М.: Изд-во «Дело и Сервис», 1999. – 112 с. 5. Клебанова Т. С. Теория экономического риска : учебн. пособ. / Т. С. Клебанова, Е. В. Раевцева. – Х. : Издательский Дом «ИНЖЕК», 2006. – 208 с. 6. Канторович Л. В. Экономика и оптимизация / Л. В. Канторович. – М. : Наука, 1990. – 212 с. 7. Петраков Н. Я. Фактор неопределенности и управление экономическими системами / Н. Я. Петраков, В.И. Ротарь. – М. : Наука, 1985. – 116 с. 8.	



Офіційний сайт Міжнародного валютного фонду. – Режим доступу : <http://www.imf.org>. 9. Офіційний сайт Міністерства економічного розвитку та торгівлі України. – Режим доступу : <http://me.kmu.gov.ua>.

Система оцінювання результатів навчання

Оцінювання сформованих компетентностей у з студентів здійснюється за накопичувальною 100-бальною системою, контрольні заходи включають: поточний контроль, що здійснюється протягом семестру під час проведення лекційних та практичних занять, написання контрольних робіт, ессе та оцінюється сумою набраних балів (максимальна сума – 60 балів); підсумковий/семестровий контроль, що проводиться у формі заліку, відповідно до графіку навчального процесу.

Більш детальна інформація щодо оцінювання наведена в технологічній карті дисципліни:

<https://pns.hneu.edu.ua/course/view.php?id=1057>

Накопичування рейтингових балів з навчальної дисципліни

Види навчальної роботи	Мах кількість балів
Відвідування лекцій	15
Виконання практичних завдань	8
Семінарські заняття	12
Тестові завдання	20
Письмова контрольна робота	24
Домашні завдання (есе)	15
Ситуаційні завдання	6
Максимальна кількість балів	100

Відповідність шкали оцінювання ЄКТС національній системі оцінювання ХНЕУ ім. С. Кузнеця

Сума балів за всі види навчальної діяльності	Оцінка ЄКТС	Оцінка за національною шкалою	
		для екзамену (іспиту), диференційованого заліку, курсового проекту (роботи), практики, тренінгу	для заліку
90 – 100	A	відмінно	зараховано
82 – 89	B	добре	
74 – 81	C		
64 – 73	D		
60 – 63	E	задовільно	не зараховано
35 – 59	FX	незадовільно	
1 – 34	F		

Політики навчальної дисципліни

Політика дотримання академічної доброчесності, Політика щодо пропусків занять, Політика щодо виконання завдань пізніше встановленого терміну см. у Робочій програмі навчальної дисципліни.

Політика навчальної дисципліни вибудовується з урахуванням норм чинного законодавства України та нормативних документів Університету. Викладання навчальної дисципліни ґрунтується на засадах академічної доброчесності, що визначено у Кодексі академічної доброчесності Харківського національного економічного університету імені Семена Кузнеця <https://www.hneu.edu.ua/akademichna-dobrocheshnist/>

Більш детальну інформацію щодо компетентностей, результатів навчання, методів навчання, форм оцінювання, самостійної роботи наведено у Робочій програмі навчальної дисципліни <https://pns.hneu.edu.ua/course/view.php?id=1057>

Силабус затверджено на засіданні кафедри 19.09.2020 р. Протокол №3