



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

Спеціальність	051 Економіка
Освітня програма	Бізнес-статистика і аналітика
Освітній рівень	Перший (бакалаврський)
Статус дисципліни	Обов'язкова
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	Екзамен
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
Консультації	Відповідно до розкладу консультацій
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 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
Система оцінювання результатів навчання Оцінювання сформованих компетентностей у студентів здійснюється за накопичувальною 100-бальною системою, контрольні заходи включають: поточний контроль, що здійснюється протягом семестру під час проведення лекційних та лабораторних занять і оцінюється сумою набраних балів (максимальна сума – 60 балів; мінімальна сума, що дозволяє студенту скласти іспит – 35 балів); підсумковий/семестровий контроль, що проводиться у формі семестрового екзамену, відповідно до графіку навчального процесу (максимальна сума – 40 балів, мінімальна сума, що дозволяє студенту скласти іспит – 25 балів). 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	12
Виконання практичних завдань	16
Семінарські заняття	12
Тестові завдання	10
Письмова контрольна робота	10
Екзамен	40
Максимальна кількість балів	100

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-dobrochesnist/>

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 22.06.2021 р. Протокол №13