

СИЛАБУС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ «УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ»



Ступінь освіти	<u>бакалавр</u>
Освітня програма	<u>051, 071, 072, 075, 242</u>
Тривалість викладання	<u>3 чверть</u>
Заняття:	<u>Весняний семестр</u>
лекції:	<u>2 години</u>
практичні заняття:	<u>2 година</u>
Мова викладання	<u>українська</u>

Сторінка курсу в СДО НТУ «ДП»: <https://do.nmu.org.ua/enrol/index.php?id=622>

Кафедра, що викладає економіки та економічної кібернетики



Викладач:
Пістунов Ігор Миколайович
Професор, доктор. техн. наук, професор
кафедри економіки та економічної
кібернетики

Персональний сайт
<http://pistunovi.inf.ua/>

Е-mail:
pistunov.i.m@nmu.one
pistunovi@gmail.com

1. Анотація до курсу

Ринкова економіка є тотально ризикова, випадковість супроводжує бізнес на всіх етапах його діяльності: при виробництві продукції, при постачання до одержувача, при отриманні коштів за свою продукцію, при компенсації за недоліки у цій продукції.

В цьому курсі студенти навчаться розраховувати абсолютну та відносну величини фінансових ризиків, математичні методи зменшення ризикованості операцій, способи обрати найкращі стратегії для бізнесу, навчитися обирати оптимальні режими роботи фірми, тощо.

Всі розрахунки вестимуться на комп'ютері із застосуванням електронних таблиць Excel.

2. Мета та завдання курсу

Мета дисципліни – формування у майбутніх бакалаврів знань і навичок щодо сучасних методів розрахунку, планування, зменшення та запобігання ризику в економічній діяльності.

Завдання курсу:

Навчитися прогнозувати наслідки реалізації прийнятих рішень у соціальній, економічній, виробничій, споживацькій та інших сферах життєдіяльності суспільства.
Управляти економічними процесами та ризиками
Опанувати сучасні технології удосконалення відомих та розробки нових методів, способів та засобів теоретичних та експериментальних досліджень в галузі економічної кібернетики.
Навчитися здійснювати проектування бізнес-процесів організацій

3. Результати навчання

Реалізація мети вимагає формування у майбутніх магістрів теоретичних основ і прийомів теоретичних основ і порядку визначення ризику та методів його зменшення необхідно для виконання професійних функцій бакалаврів з економіки.

Дисциплінарні результати навчання (ДРН)	
шифр ДРН	зміст
ДРН – 01	Вміти здійснювати кількісну оцінку ризику, визначати ризик окремої операції.
ДРН – 02	Знати загальні вимірники ризику.
ДРН – 03	Вміти визначати ризик розорення, показники ризику у вигляді відносин, кредитний ризик, депозитний ризик
ДРН – 04	Знати та вміти використовувати загальні методи зменшення ризиків: диверсифікацію, хеджування, страхування.
ДРН – 05	Вміти здійснювати якісне управління ризиками. Вміти приймати фінансові рішення в умовах ризику. Розуміти динамічні моделі планування фінансів.
ДРН – 06	Вміти здійснювати оцінку поточної вартості фірми, оцінку перспективного проекту, визначати коефіцієнти дисконтування для ризикованого проекту, знати альтернативні методи прийняття проекту

Дисциплінарні результати навчання (ДРН)	
шифр ДРН	зміст
ДРН – 07	Удосконалювати відомі та розробляти нові методи, способи та засоби теоретичних та експериментальних досліджень в галузі управління ризиками, оцінювання ризиків.
ДРН – 08	Здійснювати проектування бізнес-процесів організацій з урахуванням ризиків

4. Структура курсу

<p>ВСТУП</p> <p>Розділ 1 РИЗИК І ЙОГО ВИМІРЮВАННЯ</p> <p>1.1. Кількісна оцінка ризику</p> <p>1.2. Ризик окремої операції</p> <p>1.3. Деякі загальні вимірники ризику</p> <p>1.4. Ризик розорення</p> <p>1.5. Показники ризику у вигляді відносин</p> <p>1.6. Кредитний ризик</p> <p>1.7. Депозитний ризик</p>
<p>Розділ 2 ЗАГАЛЬНІ МЕТОДИ ЗМЕНШЕННЯ РИЗИКІВ</p> <p>2.2. Диверсифікація</p> <p>2.2. Хеджування</p> <p>2.3. Страхування</p> <p>2.4. Якісне управління ризиками</p> <p>2.5. Форвардна і ф'ючерсна торгівля</p> <p>2.6. Оптимізація статистичного контроль партії готових виробів</p> <p>2.7.2.7. Оптимальний запас продукції торгової фірми</p>
<p>Розділ 3 ФІНАНСОВІ РІШЕННЯ В УМОВАХ РИЗИКУ</p> <p>3.1. Динамічні моделі планування фінансів</p> <p>3.2. Оцінка поточної вартості фірми</p> <p>3.2.1. Чиста приведена вартість (безризикова ситуація)</p> <p>3.2.2. Коефіцієнти дисконтування для ризикованого проекту</p> <p>3.3. Оцінка перспективного проекту</p> <p>3.4. Альтернативні методи прийняття проекту</p>
<p>Розділ 4 ФУНКЦІЯ КОРИСНОСТІ НЕЙМАНА – МОРГЕНШТЕРНА</p> <p>4.1. Основні визначення і аксіоми</p> <p>4.2. Вимірювання відношення до ризику</p> <p>4.3. Страхування від ризику</p>

Розділ 5 СТРАТЕГІЧНА ГРА

5.1. Основні поняття теорії стратегічної гри

5.2. Зв'язок матричної гри з лінійним програмуванням

5.3. Змішані стратегії

5.4. Рішення задач в змішаних стратегіях для матриці 2x2

5.5. Мажорування (домінування) стратегій

5. Технічне обладнання та/або програмне забезпечення

Персональні комп'ютери з браузером та можливістю доступу до Інтернету та Microsoft Office.

6. Система оцінювання та вимоги

6.1. Навчальні досягнення здобувачів вищої освіти за результатами вивчення курсу оцінюватимуться за шкалою, що наведена нижче:

Рейтингова шкала	Інституційна шкала
90 – 100	відмінно
75-89	добре
60-74	задовільно
0-59	незадовільно

6.2. Здобувачі вищої освіти можуть отримати **підсумкову оцінку** з навчальної дисципліни на підставі поточного оцінювання знань за умови у процесі здавання лабораторних робіт, якщо набрана у суму кількість балів з поточного тестування та самостійної роботи складатиме не менше 60 балів.

Практичні роботи приймаються за контрольними запитаннями до кожної з роботи.

Теоретична частина оцінюється згідно білетів.

6.3. Критерії оцінювання підсумкової роботи

Середнє з балів, отриманих за виконання практичних завдань – 85 балів максимум та оцінка з іспиту – 25 балів максимум.

6.4. Критерії оцінювання лабораторної роботи

З кожної лабораторної роботи здобувач вищої освіти отримує завдання, які виконує самостійно і представляє результати в електронному вигляді.

7. Політика курсу

7.1. Політика щодо академічної доброчесності

Академічна доброчесність здобувачів вищої освіти є важливою умовою для опанування результатами навчання за дисципліною і отримання задовільної оцінки з поточного та підсумкового контролів. Академічна доброчесність базується на засудженні практик списування (виконання письмових робіт із залученням зовнішніх джерел інформації, крім дозволених для використання), плагіату (відтворення опублікованих текстів інших авторів без зазначення авторства), фабрикації (вигадування даних чи фактів, що використовуються в освітньому процесі). Політика

щодо академічної доброчесності регламентується положенням "Положення про систему запобігання та виявлення плагіату у Національному технічному університеті "Дніпровська політехніка". http://www.nmu.org.ua/ua/content/activity/us_documents/System_of_prevention_and_detection_of_plagiarism.pdf.

У разі порушення здобувачем вищої освіти академічної доброчесності (списування, плагіат, фабрикація), робота оцінюється незадовільно та має бути виконана повторно. При цьому викладач залишає за собою право змінити тему завдання.

7.2. Комунікаційна політика

Здобувачі вищої освіти повинні мати активовану університетську пошту.

Усі письмові запитання до викладачів стосовно курсу мають надсилатися на університетську електронну пошту.

7.3. Політика щодо перескладання

Роботи, які здаються із порушенням термінів без поважних причин оцінюються на нижчу оцінку. Перескладання відбувається із дозволу деканату за наявності поважних причин (наприклад, лікарняний).

7.4 Політика щодо оскарження оцінювання

Якщо здобувач вищої освіти не згоден з оцінюванням його знань він може опротестувати виставлену викладачем оцінку у встановленому порядку.

7.5. Відвідування занять

Для здобувачів вищої освіти денної форми відвідування занять є обов'язковим. Поважними причинами для неявки на заняття є хвороба, участь в університетських заходах, академічна мобільність, які необхідно підтверджувати документами. Про відсутність на занятті та причини відсутності здобувач вищої освіти має повідомити викладача або особисто, або через старосту.

За об'єктивних причин (наприклад, міжнародна мобільність) навчання може відбуватись в он-лайн формі за погодженням з керівником курсу.

7.6. Бонуси

Немає

8 Рекомендовані джерела інформації

Базові

1. Фрадинський О.А. (ред.) Система управління ризиками в державній митній справі України. Монографія. — Хмельницький: Науково дослідний центр митної справи НДІ ФП УДФСУ, 2019. — 228 с.
2. Суходоля О.М., Харазішвілі Ю.М., Рябцев Г.Л. Енергетична безпека України: перспективна модель управління ризиками. Монографія. — За ред. О.М. Суходолі. — Київ: Національний інститут стратегічних досліджень, 2023. — 152 с.