

Чернівецький національний університет імені Юрія Федьковича

(повне найменування головного закладу вищої освіти)

Відокремлений структурний підрозділ «Фаховий коледж

Чернівецького національного університету імені Юрія Федьковича»

(повна назва відокремленого структурного підрозділу)

Циклова комісія економічних дисциплін

(назва циклової комісії)

“ПОГОДЖЕНО”

Завідувач

Економічного відділення

“ЗАТВЕРДЖУЮ”

Заступник директора

з навчально-методичної роботи

(підпис) О.С. Гицук
(ініціали та прізвище)

(підпис) М.Я. Дерев'янчук
(ініціали та прізвище)

“ ____ ” _____ 20 ____ року

“ ____ ” _____ 20 ____ року

СИЛАБУС

навчальної дисципліни

“Моделювання економічних ризиків”

(вказіть назву навчальної дисципліни (іноземною, якщо дисципліна викладається іноземною мовою))

вибіркова

(вказати: обов'язкова/вибіркова)

Освітньо-професійна програма

“Фінанси, банківська справа та страхування”

(назва освітньо-професійної програми)

Спеціальність

072 “Фінанси, банківська справа та страхування”

(код і назва спеціальності)

Галузь знань

07 “Управління та адміністрування”

(код і назва галузі знань)

Освітньо-професійний ступінь

фаховий молодший бакалавр

(назва освітньо-професійного ступеня)

Мова навчання

українська

(вказати: на якій мові читається предмет)

Чернівці, 2020 рік

Силабус навчальної дисципліни “Моделювання економічних ризиків”
(назва навчальної дисципліни)

складений відповідно до освітньо-професійної програми

“Фінанси, банківська справа та страхування”
(назва освітньо-професійної програми)

затвердженої Вченою радою Чернівецького національного університету імені Юрія Федьковича (Протокол № 5 від «25» травня 2020 року) та введеної в дію наказом ректора №142 від «27» травня 2020 року.

Розробники: (вказати авторів, їхні посади, наукові ступені та вчені (педагогічні) звання)
викладач I-ї кваліфікаційної категорії, Крошка Т.І.

Профайл викладача (-ів)
E-mail
Сторінка курсу в Moodle
Консультації

<http://college-chnu.cv.ua/article/5f3bee3c5cc811715f5f0251t.kroshka@chnu.edu.ua>

Силабус навчальної дисципліни обговорено та узгоджено на засіданні циклової комісії
економічних дисциплін

Протокол № _____ від “ _____ ” _____ 20__ року

Голова циклової комісії _____
(підпис) *С.І. Гнат*
(ініціали та прізвище)

Схвалено Методичною радою ВСП «Фаховий коледж ЧНУ імені Юрія Федьковича»

Протокол № _____ від “ _____ ” _____ 20__ року

Голова методичної ради _____
(підпис) *О.Я. Білокрила*
(ініціали та прізвище)

ПЕРЕЗАТВЕРДЖЕНО

Протокол № _____ від _____, 20__ р.	_____	_____
	(підпис)	(ініціали та прізвище голови ЦК)
Протокол № _____ від _____, 20__ р.	_____	_____
	(підпис)	(ініціали та прізвище голови ЦК)
Протокол № _____ від _____, 20__ р.	_____	_____
	(підпис)	(ініціали та прізвище голови ЦК)

1. Загальні відомості про дисципліну

Анотація. Програма вивчення навчальної дисципліни «Моделювання економічних ризиків» складена відповідно до освітньо-професійної програми підготовки студентів освітнього рівня *«фахова передвища освіта»*, спеціальності «Облік і оподаткування». На вивчення навчальної дисципліни відводиться 90 годин (3 кредита ЄКТС)

Предметом навчальної дисципліни є вивчення та врахування основних понять ризику в економічній діяльності, для чого необхідно володіти інформацією про об'єктивність, суб'єктивність та причини виникнення ризикових ситуацій; основною схемою при роботі з моделюванням економічних ризиків є якісний та кількісний аналіз ризику, аналіз кількісних показників ризику, моделювання ризикових ситуацій та застосування на практиці основних підходів до урахування ризику та управління ним при прийнятті рішення при економічній діяльності.

Мета. Метою викладання навчальної дисципліни «Моделювання економічних ризиків» є показати студентам, що при економічній діяльності не обов'язково рухатись на осліп, використовуючи лише свій досвід та інтуїцію; робота стане набагато ефективнішою, якщо застосовувати методiku та математичний апарат для якісної оцінки ризику на практиці – це універсальний інструмент, що дозволить знизити можливість помилок при прийнятті управлінських рішень. Для цього є необхідним ознайомитись з основними поняттями та методами ризикології; виробити навички математичного дослідження економічних процесів; прищепити студентам уміння самостійно вивчати навчальну літературу; дати необхідну математичну підготовку та знання для вивчення інших дисциплін професійного спрямування, де застосовуються математичні моделі та методи для дослідження фахових питань.

Завдання. Основними завданнями навчальної дисципліни є: формувати особистість студента, як сучасного високоосвіченого спеціаліста, у поєднанні з розвитком його інтелекту, професійних здібностей та загальнолюдських цінностей і чеснот, розвинути у студентів логічне і алгоритмічне мислення, необхідне для розв'язку теоретичних і практичних задач фахового спрямування; простежити основні теоретичні аспекти розвитку теорії ризику, системи кількісних оцінок, математичного моделювання, оптимізації ризику та способів управління ним; показати застосування вивчених понять та фактів до розв'язання конкретних практичних завдань.

Пререквізити. Вивчення курсу спирається на знання, отримані у процесі вивчення дисципліни «Математика», «Вища математика».

Результати навчання. Згідно з вимогами освітньо-професійної програми студенти повинні:

знати:

- роль дисципліни в системі дисциплін економічного циклу;
- прийоми розв'язку економічних задач;
- математичний апарат, що дозволяє ефективно вирішувати економічні задачі та створювати на їх основі математичні моделі;
- основні поняття та визначення: теоретико-ігрові моделі економічного ризику, якісний та кількісний аналіз економічного ризику, багатокритеріальні ігрові моделі, врахування ризиків при управлінні;

вміти:

- використовувати вивчені поняття та методи для розв'язування задач;
- вибирати оптимальний метод розв'язування конкретної задачі;
- здійснювати аналіз та перевірку отриманого розв'язку.

Сформовані компетенції:

- *компетенції у сфері інформаційно-аналітичної діяльності:* розуміння ролі інформації в житті людини і життєдіяльності суспільства; знання основних трактувань феномену інформації, зокрема математичної і її впливу на формування сучасної картини світу; уміння враховувати закономірності перебігу математичних та комп'ютерних процесів у своїй діяльності; володіння навичками аналізу й оцінки математичної інформації з позицій її властивостей, практичної і особистої значущості;
- *компетенції у сфері пізнавальної діяльності:* розуміння суті інформаційного підходу при дослідженні математичних та комп'ютерних інформаційних процесів; знання основних етапів системно-інформаційного аналізу; володіння основними інтелектуальними операціями, такими як аналіз, порівняння, узагальнення, синтез, формалізація інформації, виявлення причинно-наслідкових зв'язків та ін.; сформованість певного рівня системно-аналітичного, логіко-комбінаторного і алгоритмічного стилів мислення; уміння генерувати ідеї й визначати засоби, необхідні для їх реалізації;
- *компетенції у сфері комунікативної діяльності:* ставлення до мов (природних, формалізованих і формальних) як до засобу комунікації; розуміння особливостей використання формальних мов; знання сучасних засобів комунікації й найважливіших характеристик каналів зв'язку; володіння основними засобами телекомунікацій; знання етичних норм спілкування і основних положень правової інформаційної діяльності;

- *технологічні компетенції*: розуміння суті технологічного підходу до організації математичної та комп'ютерної діяльності; знання особливостей автоматизованих технологій комп'ютерної інформаційної діяльності; уміння виявляти основні етапи й операції в технології розв'язання математичних та комп'ютерних задач, зокрема, за допомогою засобів автоматизації; володіння навичками виконання уніфікованих операцій, що становлять основу різних інформаційних технологій;
- *технічні компетенції*: розуміння принципів роботи, можливостей і обмежень технічних пристроїв, призначених для автоматизованої обробки математичної та комп'ютерної інформації; знання відмінностей автоматизованого і автоматичного виконання інформаційних процесів; уміння оцінювати клас завдань, які можуть бути вирішені з використанням конкретного технічного пристрою залежно від його основних характеристик;
- *компетенції у сфері соціальної діяльності й наступності поколінь*: розуміння необхідності турботи про збереження і примноження суспільних інформаційних ресурсів; готовність і здатність нести особисту відповідальність за достовірність поширюваної інформації; пошана прав інших і уміння відстоювати свої права в питаннях інформаційної безпеки особи.
- *компетенції у сфері інформаційних видів професійної діяльності*: розуміння закономірностей і особливостей перебігу інформаційних процесів у професійній діяльності; знання властивостей і характеристик професійно важливої інформації; знання основних типів інформаційних систем, які використовуються у професійній діяльності і володіння навичками роботи з цими системами; сформованість потреби у використанні новітніх інформаційних засобів при розв'язуванні практичних задач.

2. Опис навчальної дисципліни

2.1. Загальна інформація

Назва навчальної дисципліни “Моделювання економічних ризиків”						
Форма навчання	Рік підготовки	Семестр	Кількість			Вид підсумкового контролю
			Кредитів	Годин	Модулів	
Денна	3	5-6	3	90	2	ЗАЛІК

2.2. Дидактична карта навчальної дисципліни

№ за/п	Теми	Усього годин
МОДУЛЬ 1		
1.	Тема 1. Невизначеність, конфлікт і теоретико-ігрові моделі економічного ризику	12
2.	Тема 2. Якісний і кількісний аналіз економічного ризику.	12
3.	Тема 3. Моделювання економічного ризику. Ігрові моделі.	12
Разом за модулем 1		36
МОДУЛЬ 2		
4.	Тема 4. Багатоцільові та багатокритеріальні задачі. Оптимізація ризику	16
5.	Тема 5. Управління інвестиційною діяльністю підприємства. Формування оптимальної стратегії та портфеля цінних паперів	20
6.	Тема 6. Кредитний ризик. Управління запасами. Економічна безпека	18
Разом за модулем 2		54
Усього за курс		90

2.2.1. Теми лекційних занять

№	Назва теми
1.	Тема 1. Прості відсотки
2.	Тема 2. Складні відсотки
3.	Тема 3. Податки та інфляція
4.	Тема 4. Фінансові ренти
5.	Тема 5. Кредитні розрахунки
6.	Тема 6. Лізингові розрахунки

2.2.2. Теми практичних занять

№	Назва теми
7.	Тема 1. Невизначеність, конфлікт і теоретико-ігрові моделі економічного ризику
8.	Тема 2. Якісний і кількісний аналіз економічного ризику.
9.	Тема 3. Моделювання економічного ризику. Ігрові моделі.
10.	Тема 4. Багатоцільові та багатокритеріальні задачі. Оптимізація ризику
11.	Тема 5. Управління інвестиційною діяльністю підприємства. Формування оптимальної стратегії та портфеля цінних паперів
12.	Тема 6. Кредитний ризик. Управління запасами. Економічна безпека

2.2.3. Тематика індивідуальних завдань

№	Назва теми
1.	Тема 1. Невизначеність, конфлікт і теоретико-ігрові моделі економічного ризику
2.	Тема 2. Якісний і кількісний аналіз економічного ризику.
3.	Тема 3. Моделювання економічного ризику. Ігрові моделі.
4.	Тема 4. Багатоцільові та багатокритеріальні задачі. Оптимізація ризику
5.	Тема 5. Управління інвестиційною діяльністю підприємства. Формування оптимальної стратегії та портфеля цінних паперів
6.	Тема 6. Кредитний ризик. Управління запасами. Економічна безпека

2.2.4. Самостійна робота

№	Назва теми
1.	Тема 1. Невизначеність, конфлікт і теоретико-ігрові моделі економічного ризику
2.	Тема 2. Якісний і кількісний аналіз економічного ризику.
3.	Тема 3. Моделювання економічного ризику. Ігрові моделі.
4.	Тема 4. Багатоцільові та багатокритеріальні задачі. Оптимізація ризику
5.	Тема 5. Управління інвестиційною діяльністю підприємства. Формування оптимальної стратегії та портфеля цінних паперів
6.	Тема 6. Кредитний ризик. Управління запасами. Економічна безпека

4. Система контролю та оцінювання

Види та форми контролю

Формою поточного контролю є усна чи письмова відповідь студента. Підсумковим контролем є залік наприкінці 5-6 семестру.

Засоби оцінювання

1. Усне опитування.
2. Самостійна робота.
3. Практичні завдання.
4. Тестові завдання.
5. Реферати. Презентації результатів виконаних завдань та досліджень
6. Доповіді з обов'язковим захистом.
7. Виконання індивідуальних науково-дослідних робіт, та підготовка статей у збірники наукових праць, тез доповідей на конференції.

Розподіл балів, які отримують студенти

Поточне тестування та самостійна робота (Всього 50 балів)																Залік	Сума	
ЗМ1						ЗМ2										50	100	
Т 1		Т 2		Т 3		Т 4			Т 5				Т 6					
2	3	3	3	3	3	3	3	3	3	3	3	3	3	3	3			

Шкала оцінювання поточного контролю роботи

Кожного практичного заняття відбувається усне опитування, тестування або написання самостійної роботи, в які включаються питання винесені на самостійне опрацювання.

Кожна опитування або написання самостійної роботи оцінюється в 2 або 3 бали, що розподілено вище.

Шкала оцінювання для 2 балів за роботу

Оцінка за національною шкалою	Оцінка за шкалою ECTS		Пояснення за національною шкалою
	Бали	Пояснення за розширеною шкалою	
Відмінно	1,8 – 2	відмінно	ставиться, якщо студент матеріалом володіє вільно, правильно розв'язав практичні завдання
Добре	1,6 – 1,7	дуже добре	матеріалом володіє вільно, допускає деякі неточності
	1,4 – 1,5	добре	матеріалом володіє вільно, допускає деякі неточності, в практичних завданнях допущені незначні помилки
Задовільно	1,2 – 1,3	задовільно	матеріалом володіє, але прив'язаний до додаткової літератури, в практичних завданнях допускає значні помилки
	1 – 1,1	достатньо	матеріалом володіє, але прив'язаний до додаткової літератури, в практичних завданнях допускає значні грубі помилки
Незадовільно	0 – 0,9	незадовільно	матеріалом не володіє, в практичних завданнях допускає значні грубі помилки або взагалі не може розв'язати їх

Шкала оцінювання для 3 балів за роботу

Оцінка за національною шкалою	Оцінка за шкалою ECTS		Пояснення за національною шкалою
	Бали	Пояснення за розширеною шкалою	
Відмінно	2,7 – 3	відмінно	ставиться, якщо студент матеріалом володіє вільно, правильно розв'язав практичні завдання
Добре	2,4 – 2,6	дуже добре	матеріалом володіє вільно, допускає деякі неточності
	2,1 – 2,3	добре	матеріалом володіє вільно, допускає деякі неточності, в практичних завданнях допущені незначні помилки
Задовільно	1,8 – 2	задовільно	матеріалом володіє, але прив'язаний до додаткової літератури, в практичних завданнях допускає значні помилки
	1,5 – 1,6	достатньо	матеріалом володіє, але прив'язаний до додаткової літератури, в практичних завданнях допускає значні грубі помилки
Незадовільно	0 – 1,4	незадовільно	матеріалом не володіє, в практичних завданнях допускає значні грубі помилки або взагалі не може розв'язати їх

Шкала оцінювання заліку

Оцінка за національною шкалою	Оцінка за шкалою ECTS	
	Бали	Пояснення за розширеною шкалою
Відмінно	45-50	відмінно
Добре	40-44	дуже добре
	35-39	добре
Задовільно	30-34	задовільно
	25-29	достатньо
Незадовільно	0-24	незадовільно

Шкала оцінювання навчальних досягнень студентів

Сума балів за всі види навчальної діяльності	Оцінка ЄКТС	Оцінка за національною шкалою
90-100	A	зараховано
80-89	B	
70-79	C	
60-69	D	
50-59	E	
35-49	FX	не зараховано з можливістю повторного складання
0-34	F	не зараховано з обов'язковим повторним вивченням дисципліни

4. Перелік питань до заліку

1. Невизначеність - фундаментальна характеристика економічних процесів. Конфліктність в економіці. Альтернативність
2. Ризик як методологія подолання невизначеності та конфлікту
3. Класифікація інформаційних ситуацій
4. Інгредієнт функціонала оцінювання. Функція ризику
5. Зведення економічних колізій до ігрових задач
6. Основні засади якісного аналізу ризику
7. Основні підходи до кількісного аналізу ризику
8. Система кількісних оцінок міри економічного ризику
9. Оцінка ступеня портфельного ризику
10. Прийняття рішень за заданого розподілу ймовірності
11. Прийняття рішень за невідомого розподілу ймовірності
12. Критерії прийняття рішень за наявності протидії економічного середовища
13. Інформаційні ситуації
14. Критерій Паретто. Активні чисті стратегії
15. Розв'язання статистичної гри у змішаних стратегіях
16. Сутність проблеми прийняття багатокритеріальних рішень
17. Формальна постановка багатокритеріальної задачі
18. Концептуальні проблеми, пов'язані з розв'язанням багатокритеріальних задач
19. Способи нормалізації
20. Способи відображення пріоритету. Ряд пріоритету. Урахування пріоритету
21. Прийняття багатокритеріальних рішень
22. Система цілей і багатоцільова багатокритеріальна модель
23. Приклади багатоцільових задач прийняття рішень
24. Теоретико-ігровий підхід з урахуванням множини цілей
25. Критерій мінімальної відстані між інформаційними кубами
26. Ієрархічна модель прийняття багатоцільових багатокритеріальних рішень
27. Аналіз ієрархій: теоретико-ігровий підхід
28. Портфельна теорія: етапи розвитку, підходи, припущення
29. Портфель цінних паперів: числові характеристики, стратегії
30. Вибір структури портфеля з наперед заданими характеристиками
31. Теоретико-ігрова концепція вибору портфеля
32. Валютний ризик. Види валютного ризику. Управління валютними ризиками
33. Формування «валютного кошика». Визначення обсягу авансової виплати
34. Вибір управлінських рішень в економіці та підприємстві
35. Ієрархічні ігри у проблемах управління організаційними системами. Розподіл ресурсів
36. Управління активними системами

5. Рекомендована література

5.1. Базова

1. Економічний ризик: ігрові моделі: Навч. посібник / В. В. Вітлінський, П. І. Верченко, А. В. Сігал, Я. С. Наконечний; За ред. д-ра екон. наук, проф. В. В. Вітлінського. — К.: КНЕУ, 2002. — 446 с.
2. Останкова Л. А., Шевченко Н. Ю. Аналіз, моделювання та управління економічними ризиками. Навч. посіб. — К.: Центр учбової літератури, 2011. — 256 с.

5.2. Допоміжна

1. Івченко І.Ю. Моделювання економічних ризиків і ризикових ситуацій. Навчальний посібник. — К.: Центр учбової літератури, 2007. — 344 с.
2. Конспект лекцій з дисципліни “Моделювання ризиків в економіці та бізнесі” для студентів спеціальності 8.03050201 та 7. 03050201 “Економічна кібернетика” всіх форм навчання / Укл. С. В. Гринчуцька — Тернопіль, ТНТУ імені І. Пулюя, 2014. 88с.

6. Інформаційні ресурси

1. Ліга Бізнес Інформ. // www.liga.net
2. Нормативні акти України // www.nau.kiev.ua
3. Сайт Національного банку України // www.bank.gov.ua
4. Фінансовий ринок України // www.finmarket.info