

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
Національний авіаційний університет
Навчально-науковий інститут Економіки та менеджменту
Факультет економіки і підприємництва
Кафедра економічної кібернетики

ЗАТВЕРДЖУЮ
В.о.ректора

« » 2016р.



Система менеджменту якості

НАВЧАЛЬНА ПРОГРАМА
навчальної дисципліни
«Моделювання управління ризиком»


Галузь знань: 05 «Соціальні та поведінкові науки»
Спеціальність: 051 «Економіка»
Спеціалізація: «Економічна кібернетика»

Курс – 1 Семестр – 2

Аудиторні заняття – 51 Екзамен – 2 семестр
Самостійна робота – 69
Усього (годин/кредитів ECTS) – 120/4

Курсова робота – 2 семестр

Індекс НМ-6-051/16-3.1.19

	Система менеджменту якості. Навчальна програма навчальної дисципліни «Моделювання управління ризиком»	Шифр документа	СМЯ НАУ НП 14.01.06 – 01-2016
		стор. 2 з 8	

Навчальну програму дисципліни «Моделювання управління ризиком» розроблено на основі освітньо-професійної програми та навчального плану № НМ-6-051/16 підготовки фахівців освітнього ступеня «Магістр» за спеціальністю 051 «Економіка» та спеціалізацією «Економічна кібернетика» та відповідних нормативних документів.

Навчальну програму розробили:

професор кафедри економічної кібернетики _____ Т.Олешко

Навчальну програму обговорено та схвалено на засіданні випускової кафедри спеціальності 051 «Економіка», спеціалізації «Економічна кібернетика» кафедри економічна кібернетика, протокол № ___ від «___» _____ 2016 р.

Завідувач кафедри _____ Т.Олешко


Навчальну програму обговорено та схвалено на засіданні науково-методично-редакційної ради навчально-наукового інституту Економіки та менеджменту, протокол № ___ від «___» _____ 2016 р.

Голова НМРР _____ Н. Коваленко

УЗГОДЖЕНО
Директор ННІЕМ
_____ В.Матвєєв
«___» _____ 2016 р.

УЗГОДЖЕНО
Декан ФЕП
_____ О.Ареф'єва
«___» _____ 2016 р.

Рівень документа – 3б
Плановий термін між ревізіями – 1 рік
Контрольний примірник

	Система менеджменту якості. Навчальна програма навчальної дисципліни «Моделювання управління ризиком»	Шифр документа	СМЯ НАУ НП 14.01.06 – 01-2016
		стор. 3 з 8	

1. ПОЯСНЮВАЛЬНА ЗАПИСКА

Навчальна програма навчальної дисципліни «Моделювання управління ризиком» розроблена на основі «Методичних вказівок до розроблення та оформлення навчальної та робочої навчальної програм дисциплін», введених в дію розпорядженням від 16.06.2015р. №37/роз .

Дана дисципліна є теоретичною та практичною основою сукупності знань та вмінь, що формують профіль фахівця в галузі управління економічними системами.

Метою викладання дисципліни є прищеплення вміння моделювати різні показники економічного ризику відповідних економічних ситуацій, систем, сегментів ринку.

Завданнями вивчення навчальної дисципліни є:

- ознайомити з поняттям економічного ризику, класифікацією ризиків та причинами їх виникнення;
- надати знання про функції й особливості ризику в сучасних умовах;
- надати відомості про методи аналізу й оцінки ризику та типові прийоми моделювання і вимірювання економічного ризику в процесі прийняття управлінських рішень;
- навчити здійсненню вибору оптимальної стратегії в умовах ризику;
- ознайомити з методами та способами зниження ризику;
- ознайомити з процесом управління ризиком;
- надати практичні навички оцінки ризику, які потрібні під час вирішення задач відповідно до профіля спеціальності 8.03050201 «Економічна кібернетика».

У результаті вивчення даної навчальної дисципліни студент повинен:


Знати:

- джерела, суб'єкт та об'єкт ризику;
- класифікацію ризиків;
- функції ризику та особливості його виявлення в сучасних умовах;
- основні і спеціальні методи та прийоми вимірювання ризику;
- критерії вибору управлінських рішень в умовах ризику;
- як здійснюється вибір оптимальної стратегії в умовах ризику;
- способи та методи зниження економічного ризику;
- принципи управління ризиками.

Вміти:

- класифікувати ризики;
- кількісно оцінювати ризики за допомогою економіко-математичних методів;
- вибирати оптимальне управлінське рішення в умовах ризику;
- застосовувати методи зниження економічного ризику для розв'язання економічних та управлінських завдань;
- управляти ризиками.

Навчальний матеріал дисципліни структурований за модульним

	Система менеджменту якості. Навчальна програма навчальної дисципліни «Моделювання управління ризиком»	Шифр документа	СМЯ НАУ НП 14.01.06 – 01-2016
		стор. 4 з 8	

принципом і складається з двох навчальних модулів, а саме:

– навчального модуля №1 «Основні підходи до аналізу та управління економічними ризиками»

– навчального модуля №2 «Прикладні аспекти моделювання управління економічними ризиками», кожен з яких є логічно завершеною, відносно самостійною, цілісною частиною навчальної дисципліни, засвоєння якої передбачає проведення модульної контрольної роботи та аналіз результатів її виконання.

Окремим третім модулем є курсова робота, яку студент виконує в другому семестрі. КР є важливою складовою закріплення та поглиблення теоретичних та практичних знань та вмінь, набутих студентом у процесі засвоєння навчального матеріалу дисципліни

Навчальна дисципліна «Моделювання управління ризиком» базується на знаннях таких дисциплін, як: «Моделювання економіки», «Математичні основи фінансової економіки» та є базою для написання магістерського дипломного проекту (роботи).

2. ЗМІСТ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

2.1. Модуль №1 «Основні підходи до аналізу та управління економічними ризиками».

Тема 2.1.1. Ризик як економічна категорія

Поняття ризику. Причини виникнення економічного ризику. Основні джерела та риси економічного ризику. Невизначеність та ризик. Основні категорії та функції економічного ризику.

Класифікація ризиків: статичні та динамічні ризики, комерційний ризик, виробничий ризик, фінансовий ризик, інноваційний ризик, підприємницький ризик, господарський ризик, бізнес-ризик, ринковий ризик.

Особливості економічного ризику в сучасних умовах господарювання підприємства.

Тема 2.1.2. Аналіз та методи оцінки ризику


Аналіз ризику. Загальні методи оцінки ризику. Використання ймовірності для оцінки ризику. Ризик в абсолютному вираженні. Ризик у відносному вираженні.

Тема 2.1.3. Спеціальні методи оцінки ризику

Спеціальні методи оцінки ризику. Оцінка ризику на основі аналізу фінансового становища підприємства. Методи експертних оцінок. Метод аналізу доцільності витрат. Інтегральна оцінка ризику. Комплексна оцінка ризику. Оцінка ефективності нововведень. Інші методи оцінки ризику.

Тема 2.1.4. Вибір оптимальної стратегії в умовах ризику

Вибір оптимальної стратегії в умовах ризиків, пов'язаних з конфліктом. Формалізація конфліктних ситуацій. Методи знаходження оптимальних стратегій.

	Система менеджменту якості. Навчальна програма навчальної дисципліни «Моделювання управління ризиком»	Шифр документа	СМЯ НАУ НП 14.01.06 – 01-2016
		стор. 5 з 8	

Вибір оптимальної стратегії в умовах ризику, пов'язаного з не визначенням навколишнього середовища.

2.2. Модуль №2 «Прикладні аспекти моделювання управління економічними ризиками»

Тема 2.2.1. Оцінка економічного ризику на основі аналізу фінансової діяльності підприємства

Прийняття рішень в умовах невизначеності та ризику. Постановка і розв'язання задач оптимізації рішень в умовах ризику. Вибір рішення про ризикованість проекту на основі втрат прибутку.

Показники ризику при аналізі фінансової діяльності підприємства. Розробка заходів, які пом'якшують вплив ризикованих ситуацій на основі виявлення фінансових резервів підвищення конкурентоспроможності компанії.

Тема 2.2.2. Моделювання та оптимізація ризику при прийнятті рішень з реальних інвестицій

Поняття реальних інвестицій та види ризику при оцінці інвестиційних проектів. Ключові категорії та положення розробки варіантів інвестиційних проектів. Критерії оцінки інвестиційних проектів. Техніка дисконтування Майбутня вартість. Оцінка ефективності доступних можливостей інвестування.

Управління інвестиційною діяльністю підприємства на основі моделі синхронного планування. Вибір оптимальної інвестиційної стратегії.

Тема 2.2.3. Мінімізація економічних ризиків

Засіб впливу на ризик. Реалізація прийомів зниження ступеня ризику. Заходи зниження ступеня ризику. Організаційні методи зниження ризику. Відхилення ризику. Запобігання ризикам. Мінімізація збитків. Передача контролю за ризиком. Економічні методи зниження ризику. Розробка заходів, які пом'якшують вплив ризикованих ситуацій на діяльність підприємства.


Тема 2.2.4. Управління економічними ризиками

Сутність і зміст управління ризиком. Формування стратегії управління ризиком. Система управління ризиком. Принципи управління ризиком. Загальна схема процесу управління ризиком. Мета і завдання розробки програми управління ризиками. Інформаційне забезпечення розробки програми управління ризиком.

2.5. Модуль №3 «Курсова робота»

У другому семестрі студенти виконують курсову роботу (КР), відповідно до затверджених в установленому порядку методичних рекомендацій, з метою закріплення та поглиблення теоретичних та практичних знань та вмінь, набутих студентом у процесі засвоєння навчального матеріалу дисципліни в галузі управління ризиками.

Виконання КР є важливим етапом у підготовці до участі в студентських конференціях, виконання дипломної роботи майбутнього фахівця в галузі економічної кібернетики.

	Система менеджменту якості. Навчальна програма навчальної дисципліни «Моделювання управління ризиком»	Шифр документа	СМЯ НАУ НП 14.01.06 – 01-2016
		стор. 6 з 8	

Конкретна мета КР полягає в отриманні інформації згідно одержаного індивідуального завдання для виконання звіту з метою подальшого використання матеріалу при моделюванні взаємозв'язків та опрацюванні конкретного матеріалу майбутнього дипломного проекту. При цьому завдання різняться між собою варіантами.

Для успішного виконання КР студент повинен **знати** функції ризику та особливості його виявлення в сучасних умовах, основні і спеціальні методи та прийоми вимірювання ризику, критерії вибору управлінських рішень в умовах ризику, способи та методи зниження економічного ризику; **вміти** кількісно оцінювати ризики за допомогою економіко-математичних методів, вибирати оптимальне управлінське рішення в умовах ризику, застосовувати методи зниження економічного ризику для розв'язання економічних та управлінських завдань.

Виконання, оформлення та захист КР здійснюється студентом в індивідуальному порядку відповідно до методичних рекомендацій.

Час, потрібний для виконання КР, – до 30 годин самостійної роботи.

3. СПИСОК РЕКОМЕНДОВАНИХ ДЖЕРЕЛ

3.1. Основні рекомендовані джерела

3.1. Основні рекомендовані джерела

3.1.1. Сорока П.М. Аналіз, моделювання та управління ризиками: навчальний посібник / П.М. Сорока, Б.П. Сорока; за наук. ред. О.Д.Гудзинського. – К.: Університет «Україна», 2011. – 270 с.

3.1.2. Останкова Л.А. Аналіз, моделювання та управління економічними ризиками: Навч. посіб. / Л.А. Останкова, Н.Ю. Шевченко. – К.: Центр учбової літератури, 2011. – 256 с.

3.1.3. Івченко І.Ю. Моделювання економічних ризиків та ризикових ситуацій. / І.Ю. Івченко. – К.: Центр учбової літератури, 2007. – 344 с.

3.2. Додаткові рекомендовані джерела


3.2.1. Вітлінський В.В. Аналіз, оцінка і моделювання економічного ризику. / В.В. Вітлінський. – К.: Деміур, 1996. – 308 с.

3.2.2. Вітлінський В.В. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком. / В.В. Вітлінський, П.І. Верченко. – К.: Вид-во КНЕУ, 2000. – 292 с.

3.2.3. Вітлінський В.В., Ризик у менеджменті. / В.В. Вітлінський, С.І. Наконечний. – К.: Борисфен, 1996. – 336 с.

3.2.4. Економічний ризик і методи його вимірювання: Підручник. / В.В. Вітлінський, С.І. Наконечний, О.Д. Шарапов. – К.: ІЗМН, 1996. – 216 с.

3.2.5. Ястремський О.І. Моделювання економічного ризику./ О.І. Ястремський. – К.: Либідь, 1992. – 176 с.

	Система менеджменту якості. Навчальна програма навчальної дисципліни «Моделювання управління ризиком»	Шифр документа	СМЯ НАУ НП 14.01.06 – 01-2016
		стор. 8 з 8	

(Ф 03.02 – 04)

АРКУШ РЕЄСТРАЦІ РЕВІЗІЇ

№ пор.	Прізвище ім'я по-батькові	Дата ревізії	Підпис	Висновок щодо адекватності

(Ф 03.02 – 03)

АРКУШ ОБЛІКУ ЗМІН

№ зміни	№ листа (сторінки)				Підпис особи, яка внесла	Дата внесення зміни	Дата введення зміни
	Зміненого	Заміненого	Нового	Анульованого			

(Ф 03.02 – 32)

УЗГОДЖЕННЯ ЗМІН

	Підпис	Ініціали, прізвище	Посада	Дата
Розробник				
Узгоджено				
Узгоджено				
Узгоджено				