



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

Спеціальність	<i>СІ Економіка та міжнародні економічні відносини (за спеціалізаціями)</i>
Освітня програма	<i>Аналітика даних в економіці</i>
Освітній рівень	<i>Перший (бакалаврський) рівень вищої освіти</i>
Статус дисципліни	<i>Обов'язкова</i>
Мова викладання	<i>Українська</i>
Курс / семестр	<i>3 курс, 6 семестр</i>
Кількість кредитів ЄКТС	<i>5</i>
Розподіл за видами занять та годинами навчання	<i>Лекції – 24 год.</i>
	<i>Практичні – 24 год.</i>
	<i>Самостійна робота – 102 год.</i>
Форма підсумкового контролю	<i>Екзамен</i>
Кафедра	<i>Кафедра статистики і економічного прогнозування, ауд. 406 (1 корпус), телефон (057)702-18-32, сайт кафедри: https://statistics.hneu.edu.ua/</i>
Викладач (-і)	<i>Раєвська Олена Валентинівна, д.е.н., професор</i>
Контактна інформація	<i>olena.raev@gmail.com</i>
Дні занять	<i>Лекція: згідно діючого розкладу занять Лабораторні: згідно діючого розкладу занять</i>
Консультації	<i>На кафедрі статистики і економічного прогнозування, очні/онлайн, відповідно до графіку консультацій, індивідуальні та чат на сайті ПНС</i>

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

Структурно-логічна схема вивчення навчальної дисципліни

Мікроекономіка	Статистичне моделювання та прогнозування
Макроекономіка	Комплексний тренінг
Вища математика	
Статистика	

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)

Форми та методи оцінювання

Університет використовує 100 бальну накопичувальну систему оцінювання результатів навчання здобувачів вищої освіти.

Поточний контроль здійснюється під час проведення лекційних, лабораторних (семінарських) занять і має на меті перевірку рівня підготовленості здобувача вищої освіти до виконання конкретної роботи і оцінюється сумою набраних балів.

Підсумковий контроль включає семестровий контроль, який проводиться у формі екза-



мену.

Максимально можлива кількість балів за поточний контроль упродовж семестру для дисципліни форма контролю якої екзамен – 60 та мінімально можлива кількість балів – 35.

Поточний контроль включає наступні контрольні заходи: захист лабораторних робіт, семінар-ігрова дискусія, тестові завдання, домашні завдання (case study), письмові контрольні роботи.

Більш детальна інформація щодо системи оцінювання та накопичування балів з навчальної дисципліни наведена у робочому плані (технологічній карті) з навчальної дисципліни.

Політики навчальної дисципліни

Викладання навчальної дисципліни ґрунтується на засадах академічної доброчесності. Порухеннями академічної доброчесності вважаються: академічний плагіат, фабрикація, фальсифікація, списування, обман, хабарництво, необ'єктивне оцінювання. За порушення академічної доброчесності здобувачі освіти притягуються до такої академічної відповідальності: повторне проходження оцінювання відповідного виду навчальної роботи.

Більш детальну інформацію щодо компетентностей, результатів навчання, методів навчання, форм та методів оцінювання, самостійної роботи наведено у Робочій програмі навчальної дисципліни.