**Анотація з дисципліни «Ризикологія»**

Дисципліна “Ризикологія” – є однією із системотвірних у процесі формування компетенцій сучасного економіста, вона має теоретичне, методологічне і, одночасно, прикладне значення.

***Мета дисципліни*** – задовольнити потреби майбутніх фахівців з економіки і підприємництва у знаннях в області системного аналізу ризику у фінансово-кредитній сфері, зовнішньоекономічній діяльності на базі використання концептуальних положень сучасної ризикології та її інструментарію, що широко використовує кількісні методи та економіко-математичні моделі.

***Основні завдання дисципліни*:**

- набуття знань про якісні властивості та кількісні характеристики економічних процесів з урахуванням ризику – характерного чинника сучасної економіки;

- опанування методологією та методикою побудови, аналізу та застосування економіко-математичних моделей, що враховують ризик;

- вивчення низки найбільш типових прийомів моделювання та вимірювання економічного ризику у процесі прийняття рішень, опанування відповідним апаратом (методи, моделі, інформаційне та програмно-методичне комп’ютерне забезпечення) з метою практичного використання в різноманітних економічних проблемах (теоретична та прикладна економіка, фінанси, менеджмент тощо).

***Предметом курсу*** є теоретичні та практичні питання системного аналізу економічного ризику, математичні методи та моделювання економічних систем, обтяжених ризиком, опанування відповідним апаратом, що дозволяє аналізувати, враховувати та оцінювати ризик у широкому спектрі економічних проблем.

Для вивчення курсу необхідна попередня підготовка з теорії економіки, фінансів та дисциплін математичного циклу: математичного аналізу, лінійної алгебри, теорії ймовірностей та математичної статистики.

***У результаті вивчення дисципліни “ Ризикологія” студент повинен:***

***розуміти*,** що на економічні процеси впливає низка керованих ї некерованих чинників. Ці процеси розвиваються в умовах невизначеності та конфліктності, браку статистичних даних, необхідних на момент прийняття рішення. Усе це необхідно свідомо враховувати;

***знати:*** принципи раціональної поведінки в умовах, обтяжених ризиком. Методи виявлення джерел ризику, класифікувати різні типи ризиків. Опанувати сутність основних принципів щодо аналізу, кількісної оцінки ступеня ризику, моделювання ризику, методи його зниження до допустимого рівня тощо;

***вміти:*** самостійно здійснювати аналіз ризику як на якісному так і на кількісному рівні, оцінювати його ступінь, моделювати та враховувати його, керувати ризиком, застосовуючи методи адекватні цілям та прийнятій системі гіпотез у фінансово-кредитній сфері і зовнішньоекономічній діяльності.

***Перелік компетенцій***, яких набуде студент після опанування даної дисципліни:

* здійснювати аналіз ризику, який породжений невизначеністю в різних сферах економічної діяльності;
* будувати систему показників кількісного оцінювання ступенів ризику;
* моделювати ризик, застосовуючи інструментарій економіко-математичного моделювання та інформаційні технології;
* управляти ризиком та ефективністю у відповідних сферах економічної діяльності, використовуючи новітні інформаційні технології.

***Сфера реалізації набутих знань і вмінь.*** В Україні існують та створюються структурні підрозділи з ризику та безпеки у комерційних банках, інвестиційних та страхових компаніях, консалтингових фірмах, на підприємствах, у низці державних установ (Національному банку України, службах безпеки, податкових органах тощо). Ризикологія бурхливо розвивається і відкриває широкі можливості для професійного та кар‘єрного зростання фахівців економічного профілю, а також для достойного заробітку.

***Тематичний план дисципліни:***

Тема 1. Невизначеність і ризик, ефективність і ризик в економіці та управлінні. Класифікація та ідентифікація видів невизначеності

Тема 2. Якісний аналіз ризику та безпеки на засадах системного та синергетичного інструментарію

Тема 3. Система показників кількісного оцінювання ступеня ризику. Урахування структури об‘єктивної та суб‘єктивної складових

Тема 4. Ризик та елементи теорії корисності. Урахування асиметрії у сприйнятті ризику

Тема 5. Система методів та моделей управління ризиком в економіці та управлінні на засадах системного та синергетичного аналізу

Тема 6. Диверсифікація як метод зниження ступеня ризику. Теорія портфеля

Тема 7. Моделювання ризику в економіці та управлінні на підґрунті концепції та інструментарію теорії гри

Тема 8. Методи і моделі оцінювання інвестиційних, інноваційних та ІТ проектів з урахуванням ризиків

Тема 9. Моделювання ризику в аналізі та обґрунтуванні багатоцільових і багатокритеріальних рішень

Тема 10. Ризик та системні характеристики (надійність, стійкість, маневреність)

***Викладацький склад дисципліни:***

1. Вітлінський В.В., д.е.н., проф., зав. каф. ЕММ;
2. Ігнатова Ю.В., к.е.н., доцент каф. ЕММ;
3. Ткач О.В., к.е.н., доцент, доцент каф. ЕММ;
4. Кмитюк Т.Л., к.е.н., асистент каф. ЕММ та інші.

***Список літератури:***

***Основна:***

1. Верченко П.І., Великоіваненко Г.І., Демчук Н.В., Компаніченко О.С., Шатарська І.Ф. Ризикологія: Навч.-метод. посіб. для самост. вивч. дисц. – К.: КНЕУ, 2006. – 176 с.
2. Вітлінський В.В., Великоіваненко Г.І. Ризикологія в економіці та підприємництві: Монографія. – К.: КНЕУ, 2004.
3. Бланк И.А. Управление финансовыми рисками: Монография. – К.: Ника-центр,2005.-600с.

***Додаткова:***

1. Вітлінський В.В., Верченко П.І. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком: Навч.-метод. посібник для самост. вивч. дисц. – К.: КНЕУ, 2000. – 292 с.
2. Економічний ризик: ігрові моделі: Навч. посібник / В.В. Вітлінський, П.І. Верченко, А.В. Сігал, Я.С. Наконечний; За ред. В.В. Вітлінського. – К.: КНЕУ, 2002. – 446 с.
3. Вітлінський В.В. Аналіз, оцінка і моделювання економічного ризику. - К.: Деміур, 1996. - 212 с.

Завідувач кафедри економіко- Вітлінський В.В.,

математичного моделювання д.е.н., проф.