

Дніпровський національний університет імені Олеся Гончара

МЕТОДИ ТА МОДЕЛІ ВИМІРЮВАННЯ ЕКОНОМІЧНИХ РИЗИКІВ

ПРОГРАМА
вибіркової навчальної дисципліни
підготовки бакалавра

спеціальності 051 Економіка

Дніпро
2017рік

РОЗРОБЛЕНО ТА ВНЕСЕНО:

Дніпровський національний університет імені Олеся Гончара

РОЗРОБНИКИ ПРОГРАМИ:

Іванов Р.В., зав. кафедри економічної кібернетики

Обговорено та рекомендовано науково-методичною комісією галузі кафедри економічної кібернетики

“_21__”_11_ 2017_р., протокол №_5

Вступ

Програма вивчення вибіркової навчальної дисципліни «**Методи та моделі вимірювання економічних ризиків**» складена відповідно до освітньо-професійної програми підготовки бакалавра спеціальності 051 Економіка»

Предмет вивчення дисципліни: принципи, типи, інструменти методів та моделей вимірювання економічних ризиків та їх застосування для економіко-математичного моделювання та дослідження економічних явищ та процесів.

Об'єкт вивчення навчальної дисципліни: є методи та моделі вимірювання економічних ризиків.

Міждисциплінарні зв'язки: вивчення дисципліни потребує підготовки студентів з таких складових математичного циклу, як вища математика, теорія ймовірностей, економетрія, дисциплін економічного циклу.

1. Мета та завдання навчальної дисципліни

1.1. Мета навчальної дисципліни

Метою викладання навчальної дисципліни «Методи та моделі вимірювання економічних ризиків» є:

формування системи професійної компетентності (знань, прикладних вмінь та навичок) щодо формування відповідних сучасному рівню економічної освіти в Україні знань з методології, методики та інструментарію теоретичних основ математичних методів і моделей, які застосовуються в економіці в дослідженні економічних об'єктів і процесів в умовах ризику, джерел його походження, систематизованих знань щодо аналізу, моделювання та управління ризиком.

1.2. Основними завданнями вивчення дисципліни «Методи та моделі вимірювання економічних ризиків» є:

- ознайомлення з формами, джерелами виникнення та класифікації економічних ризиків;
- ознайомлення з найбільш важливими моделями вимірювання економічних ризиків;
- ознайомлення з теоретичним та експериментальним підходами до вимірювання економічних ризиків;

1.3. Згідно з вимогами освітньо-професійної програми студенти повинні:

знати:

основні принципи здійснення аналізу ризику, його моделювання, врахування та управління ним.

вміти:

здійснювати якісний аналіз, ідентифікацію ризику й проводити відповідні обчислювання, використовуючи сучасні обчислювальні засоби та відповідні

програмно-методичні комплекси, оцінювати міру ризику за певними адекватними цілям і системи прийнятих гіпотез кількісними показниками; контролювати, моделювати та враховувати ризик.

2. Інформаційний обсяг навчальної дисципліни

ЗМІСТОВНИЙ МОДУЛЬ 1

ТЕМА 1. МЕТОДОЛОГІЧНІ ПІДХОДИ ДО ТЕОРІЇ ЕКОНОМІЧНОГО РИЗИКУ. ЯКІСНИЙ АНАЛІЗ РИЗИКУ.

Основні види джерел ризику у певному виді господарської діяльності. Підходи щодо класифікації ризиків. Структура ризику у фінансовій сфері. Умови виникнення ризику та основні засади щодо його аналізу. Класифікація ризиків у різних сферах економічної та господарської діяльності.

ТЕМА 2. ОСНОВНІ ПІДХОДИ ЩОДО КІЛЬКІСНОГО АНАЛІЗУ РИЗИКУ. Дерева рішень та їх використання у кількісному аналізі ризику. Сутність методу аналізу можливих збитків. Використання імітаційного моделювання в кількісному аналізі економічного ризику. Методичні підходи до здійснення кількісного аналізу ризику методом аналогій. Метод аналізу чутливості (вразливості). Аналіз конкретних прикладів. Сутність таких понять як допустимий, критичний, катастрофічний ризик у фінансовій сфері, банківській діяльності, у зовнішньоекономічній діяльності.

ТЕМА 3. СИСТЕМА КІЛЬКІСНИХ ОЦІНОК СТУПЕНЯ РИЗИКУ.

Коефіцієнти асиметрії та варіації асиметрії. Коефіцієнт ексцесу та варіації ексцесу. Використання нерівності Чебишева. Аналіз розподілу ризик-факторів. Використання нерівності Чебишева. Середні характеристики, характеристики розсіювання, комбіновані характеристики, абсолютні та відносні показники ризику.

ТЕМА 4. РИЗИК ТА ЕЛЕМЕНТИ ТЕОРІЇ КОРИСНОСТІ. Змістова інтерпретація функції корисності з глобальною несхильністю та інтервальною байдужістю до ризику. Поняття лотереї. Основні положення теорії корисності по Нейману. Детермінований еквівалент та очікувана дохідність лотереї. Використання елементів теорії корисності у різних сферах економічної та підприємницької діяльності.

ЗМІСТОВНИЙ МОДУЛЬ 2.

ТЕМА 5. ДИВЕРСИФІКАЦІЯ ЯК ОДИН ІЗ МЕТОДІВ ЗНИЖЕННЯ СТУПЕНЯ РИЗИКУ. ТЕОРІЯ ПОРТФЕЛЯ.

Основні характеристики портфеля цінних паперів. Ризик цінних паперів у відносному вираженні. Множина можливих портфелів та множина ефективних портфелів. Підхід Марковича до зниження ризику портфеля. Включення в портфель безризикових цінних паперів. Фондові індекси та їх

використання у класичній теорії портфеля.

ТЕМА 6. МОДЕЛЮВАННЯ ЕКОНОМІЧНОГО РИЗИКУ ЩОДО ПРИЙНЯТТЯ БАГАТОЦІЛЬОВИХ ТА БАГАТОКРИТЕРІАЛЬНИХ РІШЕНЬ.

Формування набору критеріїв і розробка шкал їх оцінювання.

Побудова вирішувальних правил. Одноцільова

багатокритеріальна задача прийняття рішень в полі однієї інформаційної ситуації. Одноцільова багатокритеріальна задача прийняття рішень в полі кількох інформаційних ситуацій.

Багатоцільова багатокритеріальна задача прийняття рішень в полі кількох інформаційних ситуацій.

3. Рекомендована література

1. Вітлінський В.В. Аналіз, оцінка і моделювання економічного ризику. - К.: Деміур, 1996. - 212 с.
2. Вітлінський В.В., Наконечний С.І., Шарапов О.Д. Економічний ризик і методи його вимірювання: Підручник. - К.: ІЗМН, 1996. - 400 с.
3. Вітлінський В.В. Економічний ризик: ігрові моделі: Навч. посіб. – К.: КНЕУ, 2002. – 446с.
4. Вітлінський В.В., Верченко П.І. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком: Навч.-метод. посібник для самост. вивч. дисц. – К.: КНЕУ, 2000.-292 с.
5. Кини Р.Л., Райфа Х. Принятие решений при многих критериях: предпочтения и замещения. - М.: Наука,1981. - 560 с.

4. Форма підсумкового контролю успішності навчання – ЗАЛК

5. Засоби діагностики успішності навчання

1. Контроль систематичності та активності роботи на лекційних і лабораторних заняттях:

1) кожен студент протягом семестру виконує лабораторні роботи.

Результати виконання кожної лабораторної роботи студент оформляє у вигляді письмового звіту з додатками практичного матеріалу, одержаного в результаті комп'ютерної обробки даних. Звіт лабораторної роботи повинен містити:

- титульний лист;
- тему лабораторної роботи;
- формування мети лабораторної роботи;
- інформаційну базу;
- зміст завдання;

- порядок виконання лабораторної роботи з короткими поясненнями;
- результати виконаної лабораторної роботи, роздруковані на принтері;
- аналіз результатів;
- список використаної літератури.

Лабораторні заняття завершуються захистом звітів лабораторних робіт.

2) відвідування лекційних занять; активність, аргументованість виступів під час усного опитування та виконання самостійної роботи;

2. Контроль виконання завдань для самостійного опрацювання.

- Кожен студент виконує контрольні та самостійні роботи.