



Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця

Силабус навчальної дисципліни

«Статистичний аналіз ризиків та методи його оцінювання»

Спеціальність	051 Економіка
Освітня програма	051.100 Бізнес-статистика і аналітика
Освітній рівень	Перший (бакалаврський) рівень вищої освіти
Статус дисципліни	Обов'язкова
Мова викладання	Українська
Курс / семестр	3 курс, 6 семестр
Кількість кредитів ЄКТС	5
Розподіл за видами занять та годинами навчання	Лекції – 24 год. Практичні – 24 год. Самостійна робота – 102 год.
Форма підсумкового контролю	Екзамен
Кафедра	Кафедра статистики і економічного прогнозування, ауд. 406 (1 корпус), телефон (057)702-18-32, сайт кафедри: https://statistics.hneu.edu.ua/
Викладач (-і)	Раєвська Олена Валентинівна, д.е.н., професор
Контактна інформація	olena.raev@gmail.com
Дні занять	Лекція: згідно діючого розкладу занять Лабораторні: згідно діючого розкладу занять
Консультації	На кафедрі статистики і економічного прогнозування, очні/онлайн, відповідно до графіку консультацій, індивідуальні та чат на сайті ПНС
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	
Передумови для навчання Перелік попередньо прослуханих дисциплін: мікроекономіка, макроекономіка, вища математика, статистика, економічна статистика, менеджмент, економіка підприємства.	
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)	
Сторінка курсу на платформі Moodle (персональна навчальна система)	https://pns.hneu.edu.ua/course/view.php?id=9647
Система оцінювання результатів навчання Система оцінювання сформованих компетентностей враховує види занять, які передбачають лекційні, лабораторні заняття, а також виконання самостійної роботи. Оцінювання сформованих компетентностей у студентів здійснюється за накопичувальною 100-бальною системою. Поточний контроль, що здійснюється протягом семестру під час проведення	



Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця

лабораторних занять та самостійної роботи оцінюється сумою набраних балів. Максимальна сума – 60 балів; мінімальна сума, що дозволяє студенту скласти іспит – 35 балів.

Поточний контроль включає наступні контрольні заходи: експрес опитування, семінарські заняття, кейсові-завдання, практичні завдання, тестові завдання, домашні завдання, письмова контрольна робота.

Підсумковий/семестровий контроль проводиться у формі семестрового екзамену, відповідно до графіку навчального процесу (максимальна сума – 40 балів, мінімальна сума, що дозволяє студенту скласти іспит – 25 балів).

Більш детальна інформація щодо 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.

Порушеннями 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 оцінювання, самостійної роботи наведено у Робочій програмі навчальної дисципліни (<https://pns.hneu.edu.ua/course/view.php?id=9647>)

Силабус затверджено на засіданні кафедри 03.01.2023 р. Протокол № 7