

НАЦІОНАЛЬНИЙ АВІАЦІЙНИЙ УНІВЕРСИТЕТ

Навчально-науковий інститут Економіки та менеджменту

Факультет економіки і підприємництва

Кафедра економічної кібернетики

УЗГОДЖЕНО

Директор ННІЕМ

_____ В. Матвеев

« ___ » _____ 2016р.

ЗАТВЕРДЖУЮ

Проректор з навчальної та
методичної роботи

_____ Т.Іванова
« ___ » _____ 2016р.



Система менеджменту якості

РОБОЧА НАВЧАЛЬНА ПРОГРАМА

навчальної дисципліни

«Моделювання управління ризиком»

Галузь знань: 05 «Соціальні та поведінкові науки»

Спеціальність: 051 «Економіка»

Спеціалізація: «Економічна кібернетика»

Курс – 1 Семестр – 2

Лекції - 34 Екзамен - 2 семестр

Практичні заняття - 17

Самостійна робота - 69

Усього (годин/кредитів ECTS) - 120/4

Курсова робота - 2 семестр

Індекс НМ-6-051/16-3.1.19



Робочу навчальну програму дисципліни «Моделювання управління ризиком» розроблено на основі робочого навчального плану № НМ-6-051/16 підготовки фахівців освітнього ступеня «Магістр» за спеціальністю 051 «Економіка» та спеціалізацією «Економічна кібернетика» навчальної програми цієї дисципліни, індекс НМ-6-051/16-3.1.19 затвердженої ректором «__» _____ 2016р., та відповідних нормативних документів.

Робочу навчальну програму розробили:

професор кафедри економічної кібернетики _____ Т.Олешко

Робочу 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

Робочу 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

Рівень документа – 3б

Плановий термін між ревізіями – 1 рік

Контрольний примірник



ЗМІСТ

	стор.
1. Вступ	4
2. Зміст навчальної дисципліни	4
2.1. Тематичний план навчальної дисципліни	4
3. Навчально-методичні матеріали з дисципліни	5
3.1. Список рекомендованих джерел.....	5
3.2. Перелік наочних та інших навчально-методичних посібників, методичних матеріалів до технічних засобів навчання.....	5
4. Рейтингова система оцінювання набутих студентом знань та вмінь	6



1. ВСТУП

Робоча навчальна програма дисципліни розроблена на основі навчальної програми дисципліни «Моделювання управління ризиком» та «Методичних вказівок до розроблення та оформлення навчальної та робочої навчальної програм дисциплін», введених в дію розпорядженням від 16.06.15 №37/роз.

Рейтингова система оцінювання (PCO) є невід'ємною складовою робочої навчальної програми і передбачає визначення якості виконаної студентом усіх видів аудиторної та самостійної навчальної роботи та рівня набутих ним знань та умінь шляхом оцінювання в балах результатів цієї роботи під час поточного, модульного та семестрового контролю, з наступним переведенням оцінки за багатобальною шкалою в оцінки за національною шкалою та шкалою ECTS.

PCO передбачає використання модульних рейтингових оцінок (поточної, контрольної, підсумкової), а також екзаменаційної або залікової, підсумкової семестрової та підсумкової рейтингових оцінок.

2. ЗМІСТ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

2.1. Тематичний план навчальної дисципліни

№ пор.	Назва теми	Обсяг навчальних занять (год.)			
		Усього	Лекції	Практ. занят.	СРС
1	2	3	4	5	6
Модуль №1 «Основні підходи до аналізу та управління економічними ризиками»					
1.1	Ризик як економічна категорія	9	2 2	2	3
1.2	Аналіз оцінки ризику	9	2 2	2	3
1.3	Спеціальні методи оцінки ризику.	9	2 2	2	3
1.4	Вибір оптимальної стратегії в умовах ризику	7	2	2	3
1.5	Модульна контрольна робота №1	5	2		3
	Усього за модулем № 1	39	16	8	15
Модуль №2 «Прикладні аспекти моделювання управління економічними ризиками»					
2.1	Оцінка економічного ризику на основі аналізу фінансової діяльності підприємства	11	2 2	2	5
2.2	Моделювання та оптимізація ризику при прийнятті рішень з реальних інвестицій	11	2 2	2	5
2.3	Мінімізація економічних ризиків	11	2 2	2	5
2.4	Управління економічними ризиками	13	2 2 2	2	5



2.5	Модульна контрольна робота №2	5	-	1	4
Усього за модулем № 2		51	18	9	24
Модуль №3 «Курсова робота»					
		30	-	-	30
Усього за навчальною дисципліною		120	34	17	69

2.2. 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 у процесі засвоєння навчального матеріалу дисципліни в галузі ризикології, які використовуються в подальшому при написанні дипломної роботи магістра.

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, вибрати 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. НАВЧАЛЬНО-МЕТОДИЧНІ МАТЕРІАЛИ З ДИСЦИПЛІНИ

3.1. Список рекомендованих джерел

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.

Додаткові рекомендовані джерела

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



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

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

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

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

3.2. Перелік наочних та інших навчально-методичних посібників, методичних матеріалів до ТЗН

№ пор.	Назва	Шифр тем за тематичним планом	Кількість
1.	Методичні рекомендації з виконання практичних робіт	1.1–1.4 2.1-2.4	електронні версії
3	Методичні вказівки з виконання курсової роботи	5.1	електронна версія

4. РЕЙТИНГОВА СИСТЕМА ОЦІНЮВАННЯ НАБУТИХ СТУДЕНТОМ ЗНАТЬ ТА ВМІНЬ

4.1. Оцінювання окремих видів виконаної студентом навчальної роботи здійснюється в балах відповідно до табл. 4.1.

Таблиця 4.1

2 семестр				
Модуль №1		Модуль №2		Мах кількість балів
Вид навчальної роботи	Мах кількість балів	Вид навчальної роботи	Мах кількість балів	
Виконання завдань експрес контролю на практичних заняття (5б.х4)	20 (сумарна)	Виконання завдань експрес контролю на практичних заняття (5б.х4)	20 (сумарна)	
Розв'язання задач, відповіді на теоретичні питання, тощо під час аудиторної роботи на практичних заняттях (5б.х2)	10 (сумарна)	Розв'язання задач, відповіді на теоретичні питання, тощо під час аудиторної роботи на практичних заняттях (5б.х2)	10 (сумарна)	
		Виконання та захист домашнього завдання	8	



<i>Для допуску до виконання модульної контрольної роботи 1 студент має набрати не менше 18 балів</i>		<i>Для допуску до виконання модульної контрольної роботи 2 студент має набрати не менше 23 балів</i>		
Виконання модульної контрольної роботи 1	10	Виконання модульної контрольної роботи №2	10	
Усього за модулем №1	40	Усього за модулем №2	48	
Семестровий екзамен				12
Усього за 2 семестр				100

продовження Таблиці 4.1

2 семестр		
Модуль №3		Мах кількість балів
Вид навчальної роботи		
Виконання курсової роботи		60
Захист курсової роботи		40
Виконання та захист курсової роботи		100

4.2. Виконані види навчальної роботи зараховуються студенту, якщо він отримав за них позитивну рейтингову оцінку (табл. 4.2).


4.3. Сума рейтингових оцінок, отриманих студентом за окремі види виконаної навчальної роботи, становить поточну модульну рейтингову оцінку, яка заноситься до відомості модульного контролю.

Таблиця 4.2

Відповідність рейтингових оцінок за окремі види навчальної роботи
в балах оцінкам за національною шкалою

Рейтингова оцінка в балах			Оцінка за національною шкалою
Виконання завдань експрес контролю на практичних заняття	Розв'язання задач, відповіді на теоретичні питання, тощо під час аудиторної роботи на практичних заняттях	Виконання модульної контрольної роботи	
18-20	9-10	9-10	Відмінно
15-17	7-8	8	Добре
12-14	6	6-7	Задовільно
менше 12	менше 6	менше 6	Незадовільно

4.4. Сума поточної та контрольної модульних рейтингових оцінок становить підсумкову модульну рейтингову оцінку (табл.4.3), яка в балах та за національною шкалою заноситься до відомості модульного контролю.

	Система менеджменту якості. Робоча навчальна програма навчальної дисципліни «Моделювання управління ризиком»	Шифр документа	СМЯ НАУ РНП 14.01.06 – 01-2016
		стор. 8 з 11	

Таблиця 4.3

Відповідність підсумкових модульних рейтингових оцінок
в балах оцінкам за національною шкалою

Модуль № 1	Модуль № 2	Оцінка за національною шкалою
36 – 40	43-48	Відмінно
30 – 35	36-42	Добре
24 – 29	29-35	Задовільно
Менше 24	Менше 29	Незадовільно

4.5. Підсумкова модульна рейтингова оцінка, отримана студентом за результатами виконання та захисту курсової роботи в балах, за національною шкалою та шкалою ECTS заноситься до відомості модульного контролю.

4.6. Сума підсумкових модульних рейтингових оцінок у балах становить підсумкову семестрову модульну рейтингову оцінку, яка перераховується в оцінку за національною шкалою (табл. 4.4).

Таблиця 4.4

Відповідність підсумкової семестрової
модульної рейтингової оцінки в балах
оцінкам за національною шкалою

Оцінка в балах	Оцінка за національною шкалою
79-88	Відмінно
66-78	Добре
53-65	Задовільно
менше 53	Незадовільно

Таблиця 4.5

Відповідність екзаменаційної
рейтингової оцінки в балах оцінці
за національною шкалою

Оцінка в балах	Оцінка за національною шкалою
11-12	Відмінно
9-10	Добре
7-8	Задовільно
менше 7	Незадовільно

4.7. Сума підсумкової семестрової модульної та екзаменаційної рейтингових оцінок у балах становить підсумкову семестрову рейтингову оцінку, яка перераховується в оцінки за національною шкалою та шкалою ECTS (табл. 4.6).

Таблиця 4.6

Відповідність підсумкової семестрової рейтингової оцінки в балах
оцінці за національною шкалою та шкалою ECTS

Оцінка в балах	Оцінка за національною шкалою	Оцінка за шкалою ECTS	
		Оцінка	Пояснення
90-100	Відмінно	A	Відмінно (відмінне виконання лише з незначною кількістю помилок)



82-89	Добре	B	Дуже добре (вище середнього рівня з кількома помилками)
75-81		C	Добре (в загальному вірне виконання з певною кількістю суттєвих помилок)
67-74	Задовільно	D	Задовільно (непогано, але зі значною кількістю недоліків)
60-66		E	Достатньо (виконання задовольняє мінімальним критеріям)
35-59	Незадовільно	FX	Незадовільно (з можливістю повторного складання)
1-34		F	Незадовільно (з обов'язковим повторним курсом)

4.8. Підсумкова семестрова рейтингова оцінка в балах, за національною шкалою та шкалою ECTS заноситься до заліково-екзаменаційної відомості, навчальної картки та залікової книжки студента.

4.9. Підсумкова семестрова рейтингова оцінка заноситься до залікової книжки та навчальної картки студента, наприклад, так: **92/Відм./А, 87/Добре/В, 79/Добре/С, 68/Задов./D, 65/Задов./E** тощо.

4.10. Підсумкова модульна рейтингова оцінка, отримана студентом за результатами виконання та захисту курсової роботи, крім відомості модульного контролю, заноситься також до навчальної картки, залікової книжки та Додатку до диплома, наприклад, так: **92/Відм./А, 87/Добре/В, 79/Добре/С, 68/Задов./D, 65/Задов./E** тощо.

4.11. Підсумкова рейтингова оцінка з дисципліни визначається у балах з наступним її переведенням в оцінки за національною шкалою та шкалою ECTS.

Зазначена підсумкова рейтингова оцінка з дисципліни заноситься до Додатку до диплома.

