

Навчальна дисципліна
РИЗИКОЛОГІЯ

1.	Інформація про навчально-науковий інститут	ННІ «Каразінський банківський інститут»
2.	Курс навчання	Третій
3.	Спеціальність	072 Фінанси, банківська справа та страхування
4.	Назва ОПП	«Банківська справа та фінансовий консалтинг»
5.	Ступень підготовки	Бакалавр
6.	Мінімальна кількість студентів	15 осіб
7.	Попередні умови вивчення дисципліни	«Макроекономіка та мікроекономіка», «Фінанси, гроші і кредит», УБС студія «Банківська система (рівень А)», «Економічний аналіз (рівень А)», Банківська система (рівень В – Банківські операції)»
8.	Семестр (осінній/ весняний)	весняний
9.	Кафедра, що забезпечує викладання	Банківського бізнесу та фінансових технологій
10.	Контактні дані розробників робочої програми навчальної дисципліни	Кандидат економ. наук, Ст. викладач Вядрова Н. Г. 050-3000-918
11.	Науково-педагогічні працівники, залучені до викладання	Кандидат економ. наук, Ст. викладач Вядрова Н. Г.
12.	Мета дисципліни	формування теоретичних знань та набуття практичних навичок з реалізації продажу банківських продуктів та послуг в роздрібному сегменті банківського бізнесу
13.	Очікувані результати навчання	<p>РНД 1 Демонстрація належного рівня знань та вироблення практичних навичок з основних понять моделювання та політикою управління ризиків на підприємстві.</p> <p>РНД 2 Здатен визначати класифікаційні ознаки ризиків, види ризиків господарюючих суб'єктів, виникнення теорій ризику, політика управління ризиків на підприємстві, визначати ризикові і невизначені дії на підприємстві.</p> <p>РНД 3 Здатен розробляти алгоритм побудови функції корисності на підприємстві ураховуючи аксіоми Неймана – Моргенштерна.</p> <p>РНД 4 Здатен визначати абсолютні і відносні оцінки ризику для виміру за допомогою коефіцієнтів ризику.</p> <p>РНД 5 Здатен визначати загальні специфічні методи виміру ризиків через кількісну оцінку ризику, вербальну оцінку ризику, частоту виникнення втрат, криву ризику, трикомпонентний показник оцінки ризику.</p> <p>РНД 6 Демонстрація знань щодо теоретичних знань та вироблення практичних навичок для проведення експертних процедур та етапами проведення експертизи.</p>

		РНД 7 Здатен визначати класифікацію теорії ігор та навчитися розробляти стратегії в залежності від гри з супротивником та з «неживою» природою.
14.	Теми аудиторних занять	<p>Тема 1. Поняття та класифікація ризику. Основні засади якісного аналізу ризику</p> <p>Тема 2. Принципи управління ризиком.</p> <p>Тема 3. Основні підходи щодо вимірювання ризику</p> <p>Тема 4. Кількісний аналіз ризику</p> <p>Тема 5. Статистичні та експертні методи оцінки ступеня економічного ризику.</p> <p>Тема 6. Система кількісних показників оцінки ступеня ризику</p> <p>Тема 7. Вимірювання ризику в абсолютному та відносному вираженні. Ризик та нерівність Чебишева.</p> <p>Тема 8. Диверсифікація як спосіб зниження ризику: елементи теорії портфеля</p> <p>Тема 9. Фондові індекси; спрощена класична модель формування портфеля (модель Шарпа); систематичний та несистематичний ризику; тактика фінансового менеджера.</p> <p>Тема 10. Моделювання інвестиційних процесів в умовах невизначеності</p> <p>Тема 11. Загальна ієрархічна модель прийняття рішень. Формалізовані та неформалізовані етапи процесу побудови моделей багатоцільових задач прийняття рішень.</p> <p>Тема 12. Основні підходи до оцінки вартості підприємства: оцінка підприємства як єдиного функціонуючого комплексу; установлення вартості підприємства в порівнянні з підприємством аналогом.</p> <p>Тема 13. Запаси, резерви як способи зниження ризику</p> <p>Тема 14. Методи зниження ризику на сучасному фінансовому ринку. Хеджування за допомогою ф'ючерсних контрактів та опціонів.</p> <p>Тема 15. Методи зниження валютного ризику. Управління валютними ризиками</p>
16.	Методи контролю результатів навчання	<p>70 балів – поточний контроль та самостійна робота студентів;</p> <p>30 балів – підсумковий контроль: залік в письмовій формі</p> <p>Оцінювання відбувається за дворівневою шкалою.</p>