

**МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ЛЬВІВСЬКИЙ ДЕРЖАВНИЙ УНІВЕРСИТЕТ ФІЗИЧНОЇ КУЛЬТУРИ
ІМЕНІ ІВАНА БОБЕРСЬКОГО
КАФЕДРА ЕКОНОМІКИ ТА МЕНЕДЖМЕНТУ**

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

**Економічний ризик та методи його
вимірювання**

галузь знань 07 Управління та адміністрування
(шифр і назва галузі знань)

спеціальність 073 Менеджмент
(шифр і назва спеціальності)

факультет туризму і післядипломної та заочної освіти
(назва факультету)

рівень вищої освіти бакалавр

Робоча програма навчальної дисципліни «Економічний ризик та методи його вимірювання» для студентів спеціальності 073 Менеджмент.

V семестр (денна форма навчання), VII семестр (заочна форма навчання)

Розробник: канд. екон. наук, доцент Гуль І.Г.

Робоча програма затверджена на засіданні кафедри економіки та менеджменту

Протокол від «_____» _____ 202__ року № ____

Завідувач кафедри економіки та менеджменту

(підпис)

(Н.Ф. Павленчик)

(прізвище та ініціали)

1. ОПИС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Найменування показників	Спеціальність, рівень вищої освіти	Характеристика навчальної дисципліни	
		денна форма навчання	заочна форма навчання
Кількість кредитів – 4		Вибіркова освітня компонента	
Модулів – 1	Спеціальність 073 Менеджмент	Рік підготовки:	
Змістових модулів – 2		3-й	4-й
Індивідуальне науково-дослідне завдання -		Семестр	
Загальна кількість годин – 120		5-й	7-й
Тижневих годин для денної форми навчання: - аудиторних – 4 - самостійної роботи студента – 4	Рівень вищої освіти: бакалавр	Лекції	
		30 год.	8 год.
		Практичні, семінарські	
		30 год.	6 год.
		Лабораторні	
		-	-
		Самостійна робота	
		60 год.	106 год.
Індивідуальні завдання			
-	-		
Вид контролю: залік			

2. МЕТА ТА ЗАВДАННЯ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

1.1. Метою викладання навчальної дисципліни «Економічний ризик та методи його вимірювання» є опанування теоретичних засад ідентифікації ризику та управління ним, набуття практичних навичок вимірювання ступеня ризику та вибору способу його зниження.

1.2. Основні завдання дисципліни «Економічний ризик та методи його вимірювання» є засвоєння основних положень економічних ризиків; вивчення методичних підходів щодо аналізу ризику та управління ним; оволодіння навичками самостійно здійснювати аналіз, ідентифікацію та оцінювання ризику, використовуючи певні методи вимірювання ризиків.

1.3. Згідно з вимогами освітньої програми студенти повинні:

знати:

- сутність основних категорій економічних ризиків;
- теоретичні основи ризикології;

- основні положення ризик-менеджменту;
- класифікацію економічних ризиків;
- методичні підходи щодо аналізу та оцінки ризиків;
- методи вимірювання економічних ризиків.

вміти:

- орієнтуватись в ризикових ситуаціях, пов'язаних з різними видами підприємницької і господарської діяльності;
- розпізнавати ризик, давати йому якісну та кількісну оцінку;
- робити прогноз щодо оптимального господарювання;
- обирати доцільні напрямки виходу з ризикових ситуацій.

3. ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Змістовий модуль 1. ТЕОРЕТИКО-МЕТОДОЛОГІЧНІ ПІДХОДИ ЩОДО ЕКОНОМІЧНИХ РИЗИКІВ

Тема 1. Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття управлінських рішень

Сутність ризику як економічної категорії. Фактори виникнення економічного ризику та його функції. Взаємозв'язок ризику і прибутку. Класифікації економічних ризиків. Джерела та чинники підприємницького ризику. Види економічних ризиків.

Тема 2. Основні положення прийняття рішень в умовах ризику

Принципи прийняття рішень за умов економічного ризику. Прийняття господарського рішення на засадах оптимального планування. Порівняльна оцінка варіантів управлінських рішень з урахуванням ризику. Метод побудови дерева рішень.

Тема 3. Невизначеність та аналіз господарських рішень

Сутність та основні причини невизначеності. Видова класифікація невизначеності. Урахування фактора невизначеності в управлінні підприємством та засоби її зниження. Невизначеність як першоджерело ризику. Використання ймовірнісного підходу для обґрунтування господарських рішень в умовах невизначеності.

Тема 4. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності

Критерії обґрунтування й прийняття господарських рішень в умовах невизначеності. Матриця прибутків і матриця витрат, особливості їхньої побудови. Критерії прийняття рішень в умовах повної невизначеності: критерій Вальда, критерій оптимізму, критерій песимізму, критерій мінімаксного ризику Севіджа, критерій песимізму-оптимізму Гурвіца. Критерії прийняття рішень в умовах часткової невизначеності: критерій Байеса, критерій Бернуллі-Лапласа. Умови оптимальності альтернатив за різними критеріями прийняття рішень в умовах ризиків.

Тема 5. Теорія корисності та її застосування у процесах прийняття рішень

Теорія корисності в системі процесів прийняття рішень. Детермінований еквівалент лотереї, премія за ризик та страхова сума. Методика побудови функції корисності. Очікувана корисність події. Аксиоми теорії очікуваної корисності. Умови схильності, несхильності та байдужості до ризику. Типи осіб, що приймають рішення за ставленням до ризику.

Тема 6. Теорія ігор

Застосування елементів теорії ігор для визначення економічних ризиків. Система теорії ігор. Чиста та змішана стратегії. Гарантований результат гри. Модель торгів.

Змістовий модуль 2. ОЦІНЮВАННЯ РИЗИКІВ ТА ОСНОВНІ ПОЛОЖЕНЬ РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТУ

Тема 7. Якісне оцінювання підприємницьких ризиків

Методологія аналізу та оцінки ризику. Показники оцінки економічного ризику. Сутність і групування якісних методів оцінювання ризику. Метод мозкового штурму. Методи експертних оцінок. Методи асоціацій та аналогій. Метод Делфі. Інші евристичні методи.

Тема 8. Кількісне оцінювання підприємницьких ризиків

Використання кількісної оцінки ризику для ухвалення господарського рішення. Оцінка втрат при ухваленні господарського рішення в умовах ризику. Втрати у виробничому підприємстві. Зумовленість витрат подіями різного класу. Статистичні розподіли втрат.

Тема 9. Основи ризик-менеджменту

Загальні положення ризик-менеджменту та його структурна схема. Правила ризик-менеджменту. Організація процесу управління ризиками. Методи управління економічними ризиками та оцінка ефективності їх застосування. Стратегія ризик-менеджменту. Стратегічне планування та прогнозування економічного ризику на підприємстві.

Тема 10. Методи вимірювання економічних ризиків для зниження ступеня ризику

Основні прийоми зниження ступеню ризику. Диверсифікація ризику, її види, сфери застосування. Передача (трансфер) ризику. Типи і види контрактів. Страхування, його сутність, види. Хеджування як форма страхування валютних та цінних ризиків. Самострахування. Методи формування резервів. Лімітування, його сутність, сфера застосування. Придбання додаткової інформації для прийняття рішень щодо зниження ризику. Інші заходи зниження ризику.

4. СТРУКТУРА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Назви змістових модулів і тем	Кількість годин											
	денна форма						заочна форма					
	усього	у тому числі					усього	у тому числі				
		л	п	с	інд	с.р.		л	п	с	інд	с.р.
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Модуль 1. Економічний ризик та методи його вимірювання												
Змістовий модуль 1. ТЕОРЕТИКО-МЕТОДОЛОГІЧНІ ПІДХОДИ ЩОДО ЕКОНОМІЧНИХ РИЗИКІВ												
Тема 1. Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття управлінських рішень	10	2		2		6	12.5	-		0.5		12
Тема 2. Основні положення прийняття рішень в умовах ризику	10	2		2		6	11	0.5		0.5		10
Тема 3. Невизначеність та аналіз господарських рішень	10	2		2		6	11	0.5		0.5		10
Тема 4. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності	14	4		4		6	11.5	1		0.5		10
Тема 5. Теорія корисності та її застосування у процесах прийняття рішень	10	2		2		6	11.5	1		0.5		10
Тема 6. Теорія ігор	10	2		2		6	11.5	1		0.5		10
Разом за змістовим модулем 1	64	14		14		36	69	4		3		62
Змістовий модуль 2. ОЦІНЮВАННЯ РИЗИКІВ ТА ОСНОВНІ ПОЛОЖЕНЬ РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТУ												
Тема 7. Якісне оцінювання підприємницьких ризиків	14	4		4		6	13.5	1		0.5		12
Тема 8. Кількісне оцінювання підприємницьких ризиків	14	4		4		6	12	1		1		10
Тема 9. Основи ризик-менеджменту	14	4		4		6	13.5	1		0.5		12
Тема 10. Методи вимірювання економічних ризиків для зниження ступеня ризику	14	4		4		6	12	1		1		10
Разом за змістовим модулем 2	56	16		16		24	51	4		3		44
Усього годин	120	30		30		60	120	8		6		106

5. ТЕМИ СЕМІНАРСЬКИХ ЗАНЯТЬ

№ з/п	Назва теми	Кількість годин	
		Денна форма	Заочна форма
1	Тема 1. Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття управлінських рішень	2	0.5
2	Тема 2. Основні положення прийняття рішень в умовах ризику	2	0.5

3	Тема 3. Невизначеність та аналіз господарських рішень	2	0.5
4	Тема 4. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності	4	0.5
5	Тема 5. Теорія корисності та її застосування у процесах прийняття рішень	2	0.5
6	Тема 6. Теорія ігор	2	0.5
7	Тема 7. Якісне оцінювання підприємницьких ризиків	4	0.5
8	Тема 8. Кількісне оцінювання підприємницьких ризиків	4	1
9	Тема 9. Основи ризик-менеджменту	4	0.5
10	Тема 10. Методи вимірювання економічних ризиків для зниження ступеня ризику	4	1
Разом		30	6

6. САМОСТІЙНА РОБОТА

№ з/п	Назва теми	Кількість годин	
		Денна форма	Заочна форма
1	Тема 1. Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття управлінських рішень Конспекти самопідготовки. Реферат по темі семінарського заняття	6	12
2	Тема 2. Основні положення прийняття рішень в умовах ризику Конспекти самопідготовки. Реферат по темі семінарського заняття	6	10
3	Тема 3. Невизначеність та аналіз господарських рішень Конспекти самопідготовки. Реферат по темі семінарського заняття	6	10
4	Тема 4. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності Конспекти самопідготовки. Реферат по темі семінарського заняття	6	10
5	Тема 5. Теорія корисності та її застосування у процесах прийняття рішень Конспекти самопідготовки. Реферат по темі семінарського заняття	6	10
6	Тема 6. Теорія ігор Конспекти самопідготовки. Реферат по темі семінарського заняття	6	10
7	Тема 7. Якісне оцінювання підприємницьких ризиків Конспекти самопідготовки. Реферат по темі семінарського заняття	6	12
8	Тема 8. Кількісне оцінювання підприємницьких ризиків Конспекти самопідготовки. Реферат по темі семінарського заняття	6	10
9	Тема 9. Основи ризик-менеджменту Конспекти самопідготовки. Реферат по темі семінарського заняття	6	12
10	Тема 10. Методи вимірювання економічних ризиків для зниження ступеня ризику Конспекти самопідготовки. Реферат по темі семінарського заняття	6	10

7. ІНДИВІДУАЛЬНІ НАВЧАЛЬНО-ДОСЛІДНІ ЗАВДАННЯ

1. Прийняття рішень у процесі невизначеності та ризику
2. Алгоритм оцінки і обґрунтування господарського ризику
3. Системні властивості рішень. Еластичність рішень. Маневреність рішень
4. Надійність та ризикованість планів розвитку та функціонування економічних об'єктів
5. Основні причини і функції ризику
6. Історія наукових досліджень у галузі економічного ризику
7. Розвиток венчурного підприємства, як самостійної галузі підприємницької діяльності
8. Ідентифікація ризику як перший етап його оцінки й обґрунтування. Класифікація ризиків
9. Поведінка суб'єктів ризику. Ставлення до ризику та ефективність ризику
10. Необхідність, загальні принципи, види аналізу і оцінки ризику
11. Організаційно-методологічні підходи до аналізу і оцінки ризику
12. Оцінка ступеня економічного ризику на основі розрахунку точки беззбитковості
13. Показники ризику, методи їх визначення
14. Система методів кількісної оцінки ризику
15. Статистичний метод, його сутність, інструментарій
16. Оцінка ризику ліквідності
17. Метод експертних оцінок, його різновиди
18. Метод аналізу доцільності витрат
19. Методи «дерево рішень», аналогій, аналітичний, оцінки платоспроможності і фінансової стійкості
20. Основні методи мінімізації ризику
21. Диверсифікація ризику, її види, сфери вживання
22. Страхування, його сутність, види
23. Хеджування як форма страхування валютних та цінових ризиків
24. Лімітування, його сутність, сфера застосування

8. МЕТОДИ КОНТРОЛЮ

Поточний контроль здійснюється під час проведення практичних та семінарських занять в усній та письмовій формах.

1. Опитування.
2. Перевірка завдань для самостійної роботи.

3. Перевірка матеріалів самопідготовки.
4. Виконання завдань практичних занять.

Підсумковий контроль – залік (5 семестр – денна форма; 7 семестр – заочна форма навчання).

9. ЗАЛІКОВІ ВИМОГИ

1. Чи є відмінні ознаки у визначення ризику, економічного ризику та підприємницького ризику? Відповідь обґрунтуйте.
2. Чим ризик відрізняється від ризикової ситуації? Наведіть приклади.
3. Назвіть основні елементи ризику. У чому полягають їх особливості?
4. Які з найбільш впливових джерел ризику Вам відомі? Наведіть приклади при обґрунтуванні відповіді.
5. Що таке фактори ризику? На які види вони поділяються?
6. Що таке функція ризику? Які функції ризику Ви знаєте? Дайте їх характеристику.
7. Які риси притаманні ризику? У чому полягають їх відмінності?
8. Що таке класифікація? Які наукові передумови побудови класифікації ризиків Ви знаєте?
9. Обґрунтуйте особливості побудови системи класифікації ризиків.
10. Які критерії класифікації ризиків прийнято виділяти у вітчизняній ризикології?
11. Обґрунтуйте взаємозв'язок ризику та прибутку.
12. Які джерела та чинники підприємницького ризику вам відомі?
13. На які види поділяються ризики? Які підвиди економічних ризиків прийнято виділяти?
14. Назвіть основні методи оцінки ризиків та надайте їх характеристику.
15. Обґрунтуйте принципи прийняття управлінських рішень за умов економічного ризику.
16. Доведіть вагомість існування оціночної системи при прийнятті обґрунтованих господарських рішень та оцінюванні ризиків.
17. Що таке багатокритеріальна оцінка і її структурні складові?
18. Визначте особливості прийняття господарського рішення на засадах оптимального планування.
19. Проведіть порівняльну оцінку варіантів управлінських рішень з урахуванням ризику.
20. Обґрунтуйте критерії, що використовуються для оцінки об'єкта дослідження.
21. Опишіть етапи процесу прийняття рішення за допомогою дерева рішень.
22. У чому полягає сутність процедури прийняття рішення за допомогою дерева рішень?
23. Переваги та недоліки застосування методу побудови дерева рішень.
24. Наведіть приклади застосування методу побудови дерева рішень.

25. Що таке невизначеність? Чим вона відрізняється від ризикової ситуації?
26. Обґрунтуйте особливості функціонування вітчизняних підприємств в умовах невизначеності.
27. Визначте причини невизначеності. Відповідь проілюструйте прикладами.
28. Які види невизначеності вам відомі? Відповідь обґрунтувати.
29. Які фактори невизначеності ви знаєте? Їх відмінні риси.
30. Доведіть вагомість урахування фактору невизначеності при управлінні підприємствами.
31. Обґрунтуйте взаємозв'язок між невизначеністю та ризиком.
32. Доведіть переваги використання ймовірнісного підходу для обґрунтування господарських рішень.
33. Вкажіть відмінності між кривою переваг та картою переваг?
34. Що показує крива розподілу імовірності отримання прибутку? Мета її побудови? Чим вона відрізняється від кривої ризику?
35. Що таке критерії рішення і в яких випадках їх використовують?
36. Охарактеризуйте основні групи критеріїв вибору рішень.
37. Визначте умови застосування методу платіжної матриці.
38. Чому критерій Вальда має ще назву «критерій крайнього песимізму»?
39. Які існують особливості застосування критеріїв крайнього оптимізму та критерію песимізму?
40. Охарактеризуйте алгоритм застосування критерію Севіджа для мінімізації ризику.
41. У чому полягає сутність застосування критерію Гурвіца при мінімізації ризиків?
42. У чому полягає сутність застосування критерію Байєса?
43. Охарактеризуйте алгоритм застосування критерію Бернуллі-Лапласа.
44. Визначте провідні умови оптимальності альтернатив за різними критеріями прийняття рішень в умовах ризиків.
45. Що таке корисність? Обґрунтуйте порядок визначення корисності товару, послуги, дії і т.д.
46. У чому полягає сутність аксіом концепції корисності Неймана-Моргенштерна?
47. Побудуйте алгоритм побудови функції корисності. Що означає очікувана корисність події?
48. Які аксіоми теорії очікуваної корисності вам відомі?
49. Визначте умови схильності, несхильності та байдужості до ризику.
50. Охарактеризуйте керівника, який є нейтральним до ризику, схильним до ризику та супротивником ризику.
51. Обґрунтуйте та доведіть на прикладах поведінку керівників підприємств при прийнятті управлінських рішень.
52. Доведіть власну поведінку при прийнятті господарських рішень.
53. Обґрунтуйте застосування теорії ігор при обґрунтуванні господарських рішень в умовах ризиків.

54. Вкажіть відмінності між чистою та змішаною стратегіями.
55. Визначте особливості моделей конфліктних ситуацій.
56. Вкажіть на переваги та недоліки моделі торгів.
57. У чому полягає сутність методології аналізу та оцінки ризику?
58. Які показники оцінки використовуються для визначення економічного ризику?
59. Визначте відмінності якісного та кількісного аналізу ризику.
60. Охарактеризуйте якісну оцінку ризику.
61. Зміст експертної оцінки ризику
62. Обґрунтуйте відмінні риси методу мозкового штурму. В яких випадках доцільно його використання.
63. Доведіть переваги і недоліки застосування методу експертних оцінок.
64. Назвіть відмінні риси між методами асоціацій та аналогій.
65. Обґрунтуйте застосування методу Делфі.
66. Які інші евристичні методи ви знаєте? Надайте їх характеристику.
67. Охарактеризуйте кількісну оцінку ризику?
68. Дайте характеристику кількісної оцінки ризику в абсолютному і відносному виразі та визначте її практичне застосування.
69. Чим обумовлено використання кількісної оцінки ризику для вибору господарського рішення?
70. Охарактеризуйте види втрат у підприємницькій діяльності.
71. Яким чином змінюється структура втрат у залежності від виду підприємницької діяльності?
72. Які характерні риси притаманні втратам у виробничому процесі?
73. Які причини впливають на втрати у комерційному підприємстві?
74. Визначте особливості втрат у фінансовому підприємстві.
75. Наведіть приклади розподілу рішень щодо кількісної оцінки ризику для подій різного класу.
76. Вкажіть відзнаки статистичного розподілу втрат.
77. Що включає процес управління ризиком? Опишіть основні стадії процесу управління ризиком
78. Обґрунтуйте властивості системи управління ризиком. Визначте основні принципи управління ризиками
79. Охарактеризуйте управління ризиком як динамічний процес Які існують етапи управління ризиком і як вони пов'язані один з одним?
80. Поясніть, у чому проявляється системний характер ризик-менеджменту.
81. У чому полягає широке та вузьке значення поняття «управління ризиками»?
82. Обґрунтуйте основні правила ризик-менеджменту.
83. Надайте характеристику об'єктам та суб'єктам управління ризиками, наведіть приклади.
84. Що включає структура системи управління ризиком? Побудуйте схему організації управління ризиком на підприємстві.

85. Доведіть необхідність моніторингових досліджень для вдосконалення системи управління ризиком.

86. Доведіть, що стратегія управління ризиком відрізняється від тактики і політики управління ризиком.

87. Обґрунтуйте необхідність розробки стратегії ризик-менеджменту.

88. Опишіть класифікацію методів управління ризиками. Наведіть основні ознаки провідних методів управління ризиками.

89. Доведіть необхідність стратегічного планування та прогнозування економічного ризику на підприємстві.

10. РОЗПОДІЛ БАЛІВ, ЯКІ ОТРИМУЮТЬ СТУДЕНТИ РОЗПОДІЛ БАЛІВ ЗА ВИДАМИ КОНТРОЛІВ

Форма навчання	Поточне тестування та самостійна робота										Сума	
	Змістовий модуль 1					Змістовий модуль 2						
	T1	T2	T3	T4	T5	T6	T7	T8	T9	T10		
Денна (усього балів)	0-10	0-10	0-10	0-10	0-10	0-10	0-10	0-10	0-10	0-10	0-10	100
Опитування на практичних	0-6	0-6	0-6	0-6	0-6	0-6	0-6	0-6	0-6	0-6		
Конспекти самопідготовки	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2		
Практична робота	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
Самостійні роботи	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2		
Заочна (усього балів)	0-10	0-10	0-10	0-10	0-10	0-10	0-10	0-10	0-10	0-10		
Опитування на практичних	0-6	0-6	0-6	0-6	0-6	0-6	0-6	0-6	0-6	0-6		
Конспекти самопідготовки	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2		
Практична робота	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
Самостійні роботи	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2	0-2		

Шкала оцінювання (національна та ECTS)

Сума балів	Оцінка ECTS	Оцінка за національною шкалою	
		для екзамену	для заліку
90-100	A	відмінно	зараховано
82-89	B	добре	
75-81	C		
68-74	D		
61-67	E	задовільно	
35-60	FX	незадовільно з можливістю повторного складання	не зараховано з можливістю повторного складання

0-34	Ф	незадовільно з обов'язковим повторним вивченням дисципліни	не зараховано з обов'язковим повторним вивченням дисципліни
------	---	--	---

11. МЕТОДИЧНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ

Теми та зміст семінарських занять

Семінарське заняття №1

з дисципліни «Економічний ризик та методи його вимірювання» **ПІДПРИЄМНИЦЬКІ РИЗИКИ ТА ЇХ ВПЛИВ НА ПРИЙНЯТТЯ УПРАВЛІНСЬКИХ РІШЕНЬ**

План семінарського заняття

- 1.1. Сутність ризику як економічної категорії
- 1.2. Фактори виникнення економічного ризику та його функції
- 1.3. Взаємозв'язок ризику і прибутку
- 1.4. Класифікації економічних ризиків
- 1.5. Джерела та чинники підприємницького ризику
- 1.6. Види економічних ризиків

Семінарське заняття №2

з дисципліни «Економічний ризик та методи його вимірювання» **ОСНОВНІ ПОЛОЖЕННЯ ПРИЙНЯТТЯ РІШЕНЬ В УМОВАХ РИЗИКУ**

План семінарського заняття

- 2.1. Принципи прийняття рішень за умов економічного ризику
- 2.2. Прийняття господарського рішення на засадах оптимального планування
- 2.3. Порівняльна оцінка варіантів управлінських рішень з урахуванням ризику
- 2.4. Метод побудови дерева рішень

Семінарське заняття №3

з дисципліни «Економічний ризик та методи його вимірювання» **НЕВИЗНАЧЕНІСТЬ ТА АНАЛІЗ ГОСПОДАРСЬКИХ РІШЕНЬ**

План семінарського заняття

- 3.1. Сутність та основні причини невизначеності
- 3.2. Видова класифікація невизначеності
- 3.3. Урахування фактора невизначеності в управлінні підприємством та засоби її зниження
- 3.4. Невизначеність як першоджерело ризику
- 3.5. Використання ймовірнісного підходу для обґрунтування господарських рішень в умовах невизначеності

Семінарське заняття №4

з дисципліни «Економічний ризик та методи його вимірювання» **КРИТЕРІЇ ПРИЙНЯТТЯ РІШЕНЬ В УМОВАХ НЕВИЗНАЧЕНОСТІ**

План семінарського заняття

- 4.1. Критерії обґрунтування й прийняття господарських рішень в умовах невизначеності
- 4.2. Матриця прибутків і матриця витрат, особливості їхньої побудови
- 4.3. Критерії прийняття рішень в умовах повної невизначеності: критерій Вальда, критерій оптимізму, критерій песимізму, критерій мінімаксного ризику Севіджа, критерій песимізму-оптимізму Гурвіца
- 4.4. Критерії прийняття рішень в умовах часткової невизначеності: критерій Байеса, критерій Бернуллі-Лапласа
- 4.5. Умови оптимальності альтернатив за різними критеріями прийняття рішень в умовах ризиків

Семінарське заняття №5

з дисципліни «Економічний ризик та методи його вимірювання» **ТЕОРІЯ КОРИСНОСТІ ТА ЇЇ ЗАСТОСУВАННЯ У ПРОЦЕСАХ ПРИЙНЯТТЯ РІШЕНЬ**

План семінарського заняття

- 5.1. Теорія корисності в системі процесів прийняття рішень
- 5.2. Детермінований еквівалент лотереї, премія за ризик та страхова сума
- 5.3. Методика побудови функції корисності. Очікувана корисність події
- 5.4. Аксиоми теорії очікуваної корисності
- 5.5. Умови схильності, несхильності та байдужості до ризику
- 5.6. Типи осіб, що приймають рішення за ставленням до ризику

Семінарське заняття №6

з дисципліни «Економічний ризик та методи його вимірювання» **ТЕОРІЯ ІГОР**

План семінарського заняття

- 6.1. Застосування елементів теорії ігор для визначення економічних ризиків
- 6.2. Система теорії ігор. Чиста та змішана стратегії. Гарантований результат гри
- 6.3. Модель торгів

Семінарське заняття №7

з дисципліни «Економічний ризик та методи його вимірювання» **ЯКІСНЕ ОЦІНЮВАННЯ ПІДПРИЄМНИЦЬКИХ РИЗИКІВ**

План семінарського заняття

- 7.1. Методологія аналізу та оцінки ризику. Показники оцінки економічного ризику
- 7.2. Сутність і групування якісних методів оцінювання ризику
- 7.3. Метод мозкового штурму
- 7.4. Методи експертних оцінок
- 7.5. Методи асоціацій та аналогій
- 7.6. Метод Делфі
- 7.7. Інші евристичні методи

Семінарське заняття №8
з дисципліни «Економічний ризик та методи його вимірювання»
КІЛЬКІСНЕ ОЦІНЮВАННЯ ПІДПРИЄМНИЦЬКИХ РИЗИКІВ
План семінарського заняття

- 8.1. Використання кількісної оцінки ризику для ухвалення господарського рішення
- 8.2. Оцінка втрат при ухваленні господарського рішення в умовах ризику
- 8.3. Втрати у виробничому підприємстві
- 8.4. Зумовленість витрат подіями різного класу
- 8.5. Статистичні розподіли втрат

Семінарське заняття №9
з дисципліни «Економічний ризик та методи його вимірювання»
ОСНОВИ РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТУ

План семінарського заняття

- 9.1. Загальні положення ризик-менеджменту та його структурна схема
- 9.2. Правила ризик-менеджменту
- 9.3. Організація процесу управління ризиками
- 9.4. Методи управління економічними ризиками та оцінка ефективності їх застосування
- 9.5. Стратегія ризик-менеджменту
- 9.6. Стратегічне планування та прогнозування економічного ризику на підприємстві

Семінарське заняття №10
з дисципліни «Економічний ризик та методи його вимірювання»
МЕТОДИ ВИМІРЮВАННЯ ЕКОНОМІЧНИХ РИЗИКІВ ДЛЯ
ЗНИЖЕННЯ СТУПЕНЯ РИЗИКУ

План семінарського заняття

- 10.1. Основні прийоми зниження ступеню ризику
- 10.2. Диверсифікація ризику, її види, сфери застосування
- 10.3. Передача (трансфер) ризику. Типи і види контрактів
- 10.4. Страхування, його сутність, види
- 10.5. Хеджування як форма страхування валютних та цінових ризиків
- 10.6. Самострахування. Методи формування резервів
- 10.7. Лімітування, його сутність, сфера застосування
- 10.8. Придбання додаткової інформації для прийняття рішень щодо зниження ризику
- 10.9. Інші заходи зниження ризику

12. РЕКОМЕНДОВАНА ЛІТЕРАТУРА

Основна

1. Балджи М.Д. Економічний ризик та методи його вимірювання. Навчальний посібник / М.Д. Балджи. – Харків: Промарт, 2015. – 300 с.
2. Економічний ризик: методи оцінки та управління : навч. посібник / [Т.А. Васильєва, С.В. Леонов, Я.М. Кривич та ін.]; під заг. ред. д-ра екон. наук, проф. Т.А. Васильєвої, канд. екон. наук Я.М. Кривич. – Суми: ДВНЗ «УАБС НБУ», 2015. – 208 с.
3. Кігель В.Р. Ризикологія: теоретичні основи та прикладні задачі, моделі і методи: Навчальний посібник для студентів економічних спеціальностей / В.Р. Кігель. - К.: Міленіум, 2017. - 230 с
4. Мороз В.М. Ризик-менеджмент: навч. посібник / В.М. Мороз, С.А. Мороз. – Харків: НТУ «ХПІ», 2018. – 140 с.
5. Стешенко О.Д. Ризикологія: Навч. посібник / О.Д. Стешенко. – Харків: УкрДУЗТ, 2019. – 180 с.

Додаткова

1. Артими-Дрогомирецька З.Б. Економічний ризик: Навчальний посібник / З.Б. Артим-Дрогомирецька. - К.: Центр учбової літератури, 2013.- 316 с.
2. Гринчуцька В. Моделювання ризиків в економіці та бізнесі / В. Гринчуцька. – Тернопіль: ТНТУ імені І. Пулюя, 2014.- 88 с.
3. Гуменюк В.Я. Управління ризиками: навч. посіб. / В.Я. Гуменюк, Г.Ю. Міщук, О.О. Олійник. – Рівне : НУВГП, 2009. - 156 с.
4. Кузьмін О.Є. Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків: навчальний посібник / О.Є. Кузьмін, Г.Л. Вербицька, О.Г. Мельник. - Львів: Видавництво Національного університету «Львівська політехніка», 2008. - 212 с.
5. Обґрунтування господарських рішень та оцінка ризиків: навч. посібник / М.Д. Балджи, В.А. Карпов, А.І. Ковальов та ін. – Одеса : ОНЕУ, 2013. – 670 с.

Інформаційні ресурси інтернет

1. Державний комітет статистики України. – Режим доступу: www.ukrstat.gov.ua.
2. Європейський центральний банк. – Режим доступу: www.ecb.europa.eu.
3. Законодавство України. – Режим доступу: zakon.rada.gov.ua.
4. Міжнародний центр перспективних досліджень. – Режим доступу: www.icps.kiev.ua.
5. Міністерство економічного розвитку і торгівлі України. – Режим доступу: www.me.gov.ua.
6. Національна бібліотека України імені В.І. Вернадського. – Режим доступу: www.nbuv.gov.ua.
7. Національний банк України. – Режим доступу: www.bank.gov.ua.

8. Світовий банк. – Режим доступу: www.worldbank.org.
9. Центр соціально-економічних досліджень. – Режим доступу: www.case-ukraine.com.ua.