

**ЛЬВІВСЬКИЙ ДЕРЖАВНИЙ УНІВЕРСИТЕТ ФІЗИЧНОЇ КУЛЬТУРИ
ІМЕНІ ІВАНА БОБЕРСЬКОГО**

Кафедра економіки та менеджменту

Гуль І.Г

ТЕМИ ТА ЗМІСТ СЕМІНАРСЬКИХ ЗАНЯТЬ

з навчальної дисципліни
«ЕКОНОМІЧНИЙ РИЗИК ТА МЕТОДИ ЙОГО ВИМІРЮВАННЯ»
Для студентів спеціальності 073 Менеджмент

«ЗАТВЕРДЖЕНО»
на засіданні кафедри економіки
та менеджменту
«___» _____ 202__ р. протокол №___
Зав. каф. _____ Н.Ф. Павленчик

ТЕМИ ТА ЗМІСТ СЕМІНАРСЬКИХ ЗАНЯТЬ
з дисципліни «Економічний ризик та методи його вимірювання»

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 Байєса, 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

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 «ХП», 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. Артими-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.