

**ЛЬВІВСЬКИЙ ДЕРЖАВНИЙ УНІВЕРСИТЕТ ФІЗИЧНОЇ КУЛЬТУРИ
ІМЕНІ ІВАНА БОБЕРСЬКОГО
КАФЕДРА ЕКОНОМІКИ ТА МЕНЕДЖМЕНТУ**

СИЛАБУС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

«Економічний ризик та методи його вимірювання»

Рівень вищої освіти	–	Перший (бакалаврський) рівень
Ступінь вищої освіти	–	Бакалавр
Галузь знань	–	07 Управління та адміністрування
Спеціальність	–	073 Менеджмент
Освітня програма	–	Менеджмент
Кількість кредитів	–	4,0 кредити ЄКТС (120 год., із них: аудиторних – 60 год.; самостійної роботи студента – 60 год.
Форма навчання	–	денна
Рік підготовки	–	рік – 3, семестр – 5
Компонент освітньої програми	–	вибіркова
Дні занять	–	відповідно до розкладу
Консультації	–	відповідно до графіку навчального процесу
Мова викладання	–	українська

Керівник курсу:

Гуль Іван Григорович – кандидат економічних наук, доцент

Контактна інформація:

Адреса: 79007, вул. Костюшка, 11, м. Львів, ауд. 213., тел. (032) 255-41-32

e-mail: gul_ivan@ukr.net

Опис дисципліни

Ризик властивий будь-якій сфері людської діяльності, що пов'язана з безліччю умов і факторів, які приводять до позитивного або негативного результату прийнятих індивідуумами рішень. Історичний досвід показує, що ризик недоодержання намічених результатів особливо став проявлятися в умовах загальності товарно-грошових відносин, конкуренції учасників господарського обороту, тому з виникненням і розвитком капіталістичних відносин з'являються різні теорії ризику, а класики економічної теорії особливу увагу приділяють дослідженню проблем ризику в підприємницькій діяльності. Якщо ризик неминучий, то особливу актуальність здобуває проблема його аналізу, оцінки, вибору методів вимірювання й можливостей подальшого управління. У результаті проведення аналізу ризику виходить картина можливих ризикових подій, імовірність їхнього настання й наслідків; оцінювання ризиків за допомогою спеціальних методів. Після порівняння отриманих значень ризиків із гранично припустимими розробляється стратегія керування ризиком, і на цій основі – пропонуються міри запобігання та зменшення ризику.

Предметом вивчення навчальної дисципліни «Економічний ризик та методи його вимірювання» є комплексна система виявлення ризиків та їх оцінки, за допомогою спеціальних методів, елементами якої є ідентифікація ризику (якісний аналіз), вимір ризику (кількісний аналіз) і його оптимізація, логічним завершенням якої виступає управління ризиками.

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.

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.

Навчальний контент

Назви змістових тем	Розподіл годин				Результати навчання. Знати:
	разом	л	с	с.р.	
Тема 1. Підприємницькі ризику та їх вплив на прийняття управлінських рішень	10	2	2	6	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	10	2	2	6	Принципи прийняття рішень за умов економічного ризику. Прийняття господарського рішення на засадах оптимального планування. Порівняльна оцінка варіантів управлінських рішень з урахуванням ризику.
Тема 3. Невизначеність та аналіз господарських рішень	10	2	2	6	Сутність та основні причини невизначеності. Видова класифікація невизначеності. Урахування фактора невизначеності в управлінні підприємством та засоби її зниження. Використання ймовірнісного підходу для обґрунтування господарських рішень в умовах невизначеності.
Тема 4. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності	14	4	4	6	Критерії обґрунтування й прийняття господарських рішень в умовах невизначеності. Матриця прибутків і матриця витрат, особливості їхньої побудови. Критерії прийняття рішень в умовах повної невизначеності. Умови оптимальності альтернатив за різними критеріями прийняття рішень в умовах ризиків.
Тема 5. Теорія корисності та її застосування у процесах прийняття рішень	10	2	2	6	Теорія корисності в системі процесів прийняття рішень. 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	10	2	2	6	Застосування елементів теорії ігор для визначення економічних ризиків. Система теорії ігор. Чиста та змішана стратегії. Гарантований результат гри. Модель торгів.
Тема 7. Якісне оцінювання підприємницьких ризиків	14	4	4	6	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.

Тема 8. Кількісне оцінювання підприємницьких ризиків	14	4	4	6	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	14	4	4	6	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.
Тема 10. Методи вимірювання економічних ризиків для зниження ступеня ризику	14	4	4	6	Основні прийоми зниження ступеню ризику. Диверсифікація ризику, її види, сфери застосування. Хеджування як форма страхування валютних та цінкових ризиків. Методи формування резервів. Придбання додаткової інформації для прийняття рішень щодо зниження ризику. Інші заходи зниження ризику.
Усього годин	120	30	30	60	

Формування програмних компетентностей

- знати теоретичні основи ризикології, сутність основних категорій та класифікацію економічних ризиків;
- знати основні положення ризик-менеджменту;
- знати 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;
- вміти розпізнавати ризик, давати йому якісну та кількісну оцінку, робити прогноз щодо оптимального господарювання;
- вміти обирати доцільні напрямки виходу з ризикових ситуацій.

Політика оцінювання

Передбачає дотримання принципів доброчесності та студентоцентрованого підходу.

Оцінювання

Оцінювання якості знань студентів здійснюється відповідно до:

Положення ЛДУФК - <http://ldufk.edu.ua/index.php/navchalna-robota.html>

Робочої програми - <http://repository.ldufk.edu.ua/simple-search?filterquery>

Порядку оцінювання - <http://repository.ldufk.edu.ua/simple-search?filterquery>

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. 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.