****

### МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ

**ЛЬВІВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ ІМЕНІ ІВАНА ФРАНКА**

|  |
| --- |
| **ЗАТВЕРДЖУЮ** |
| **В. о.  декана**  **\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ доц. Стасишин А. В.** |
| **«\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 2019 р.** |

## **ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ**

|  |
| --- |
| **ЕКОНОМІЧНІ РИЗИКИ ТА МЕТОДИ ЇХ ВИМІРЮВАННЯ** |
| (назва навчальної дисципліни) |
| **галузь знань:** 05 «Соціальні та поведінкові науки» |
| (шифр і назва галузі знань) |
| **спеціальність:**051 «Економіка»  (код та найменування спеціальності)  **спеціалізація:** Інформаційні технології в бізнесі |
| (найменування спеціалізація) |

**освітній ступінь:** бакалавр \_\_

(бакалавр/магістр)

**ЛЬВІВ 2019**

**Кафедра економічної кібернетики**

Робоча програма навчальної дисципліни “Економічні ризики та методи їх вимірювання” для студентів, які навчаються за галуззю знань 05 “Соціальні та поведінкові науки” спеціальністю 051 «Економіка» спеціалізацією «Інформаційні технології в бізнесі» освітнього ступеня бакалавр.

“\_\_\_” \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 2019 року – 19 с.

**Розробник:** Васьків О. М., ст. викладач кафедри економічної кібернетики.

**Розглянуто та ухвалено на засіданні кафедри економічної кібернетики**

Протокол №\_\_ від “\_\_\_”\_\_\_\_\_\_\_\_\_2019 р.

В. о. завідувача кафедри \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ Шевчук І.Б.

(підпис) (прізвище, ініціали)

**Розглянуто та ухвалено Вченою радою факультету управління фінансами та бізнесу**

Протокол № \_\_ від “\_\_\_” \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_2019 р.

© Васьків О. М., 2019 рік

© ЛНУ імені Івана Франка, 2019 рік

**ЗМІСТ**

1. ПОЯСНЮВАЛЬНА ЗАПИСКА………………………………………………4

2. ТЕМАТИЧНИЙ ПЛАН НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ……………………7

3. ЗМІСТ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ………………………………………7

4. СПИСОК РЕКОМЕНДОВАНОЇ ЛІТЕРАТУРИ…………………………….10

5. ГРАФІК РОЗПОДІЛУ НАВЧАЛЬНОГО ЧАСУ ЗА ТЕМАМИ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ ТА ВИДАМИ НАВЧАЛЬНОЇ РОБОТИ…………………………………………………………………………..13

6. КАЛЕНДАРНО-ТЕМАТИЧНИЙ ПЛАН АУДИТОРНИХ ЗАНЯТЬ……...13

6.1. КАЛЕНДАРНО-ТЕМАТИЧНИЙ ПЛАН ЛЕКЦІЙНИХ ЗАНЯТЬ………13

6.2. КАЛЕНДАРНО-ТЕМАТИЧНИЙ ПЛАН ЛАБОРАТОРНИХ ЗАНЯТЬ ТА ЗАЛІКОВИХ МОДУЛІВ………………………………………………………...13

6.3. ГРАФІК ОБОВ’ЯЗКОВИХ КОНСУЛЬТАТЦІЙ………………………….14

7. ПЛАНИ ЛАБОРАТОРНИХ ЗАНЯТЬ………………………………………..14

8. САМОСТІЙНА РОБОТА СТУДЕНТІВ (СРС)……………………………...15

9. МЕТОДИ ОЦІНЮВАННЯ ЗНАНЬ СТУДЕНТІВ…………………………..16

10. МЕТОДИЧНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ ДИСЦИПЛІНИ………………………...19

10.1. МЕТОДИЧНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ ДИСЦИПЛІНИ………………………18

10.2.МЕТОДИКИ АКТИВІЗАЦІЇ ПРОЦЕСУ НАВЧАННЯ……………….....18

11. РЕСУРСИ МЕРЕЖІ ІНТЕРНЕТ…………………………………………….19

**1. ПОЯСНЮВАЛЬНА ЗАПИСКА**

Ризик притаманний будь-якій сфері людської діяльності. Це пов’язано з багатьма умовами та чинниками, які впливають на позитивний результат рішень, що приймаються. Ризик неотримання прогнозних показників почав яскравіше проявлятись при товарно-грошових відносинах, конкурентній боротьбі суб’єктів господарського процесу. Будь-який суб’єкт ринкових відносин проявляє власну готовність іти на ризик в умовах невизначеності, тому що поряд з ризиком втрат існує можливість додаткових доходів. Тому становлення ринкових відносин, побудованих на економічних законах, зумовило необхідність вивчення теорії ризику.

**Предмет навчальної дисципліни**

**Предметом навчальної дисципліни** є теоретичні і практичні питання аналізу економічного ризику, математичні методи і моделювання поведінки економічних систем з урахуванням ризику.

**Мета та завдання навчальної дисципліни**

**Метою навчальної дисципліни** є фундаментальне навчання майбутніх фахівців з економіки та фінансів систематизованими знаннями щодо аналізу, моделювання та управління економічним ризиком, стратегією та тактикою антикризового управління економічним об’єктом в реальних умовах, навчити приймати оптимальні рішення в ситуаціях невизначеності та конфліктності. виробити у майбутніх фахівців розуміння суті економічних явищ і процесів.

**Основні завдання**: набуття навичок щодо оцінки та аналізу ступеня ризикованості прийняття управлінських рішень для забезпечення ефективного управління підприємством, що функціонує в умовах нестабільного зовнішнього середовища; вироблення у майбутніх фахівців глибокого розуміння суті економічних явищ і процесів; гнучкого професійного мислення, оволодіння сучасною, що враховує ризик, методологією аналізу та прийняття раціональних рішень, стратегією і тактикою антикризового управління економічним об’єктом в реальних умовах.

**Місце навчальної дисципліни в структурно-логічній схемі**

Дисципліна «Економічні ризики та методи їх вимірювання» взаємопов’язана з такими дисциплінами як «Макроекономіка», «Мікроекономіка», «Інформатика», «Оптимізаційні методи та моделі», «Економіко-математичне моделювання».

**Вимоги до знань та умінь**

У результаті вивчення навчальної дисципліни студенти повинні:

***а) знати***:

* джерело, об'єкт і суб'єкт ризику;
* основні категорії економічного ризику;
* принципи керування економічними ризиками;
* класифікацію видів ризику;
* загальні та специфічні методи виміру ризику; кількісні та якісні, а також абсолютні і відносні оцінки ризику;
* критерії вибору управлінських рішень в умовах ризику;
* методи зниження економічного ризику;
* основні наукові підходи та сучасні концепції ризикології;
* проблеми застосування теоретичних розробок ризикології до українського ринку;
* можливості використання ризикології при прийнятті рішень в умовах невизначеності;
* пріоритетні дослідження українських науковців-ризикологів

***б) уміти***:

* здійснювати якісний і кількісних аналіз ризику проектів;
* розробляти заходи для оптимізації і управління ризиком;
* визначати вид ризику, що впливає на прийняття конкретного управлінського рішення;
* кількісно оцінювати вплив ризику за допомогою економіко- математичних методів;
* приймати оптимальні управлінські рішення з використанням різноманітних критеріїв теорії ігор;
* застосовувати ризикологію для формування портфеля цінних паперів, «валютного кошика», управлінні ризиком у менеджменті;
* розробляти й вирішувати актуальні питання теорії і практики підприємницької діяльності в умовах ризику;
* застосовувати знання з ризикології в практичній діяльності.

Опанування навчальної дисципліни **«Економічні ризики та методи їх вимірювання»** повинно задовольняти необхідний рівень сформованості вмінь:

|  |  |
| --- | --- |
| Назва рівня сформованості вміння | Зміст критерію сформованості вміння |
| Репродуктивний | Вміння відтворювати знання, передбачені цією програмою |
| Алгоритмічний | Вміння використовувати у практичній діяльності знання при розв’язуванні типових ситуацій |
| Творчий | Здійснювати еврестичний пошук і використовувати знання для розв’язання нестандартних завдань та проблемних ситуацій |

Програма складена на **4 кредити**.

**Форма контролю**: проміжний модульний контроль, іспит.

**2. ОПИС ПРЕДМЕТА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ**

**„ЕКОНОМІЧНІ РИЗИКИ ТА МЕТОДИ ЇХ ВИМІРЮВАННЯ”**

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Характеристика навчальної дисципліни | | | | | | | |
| **Шифр та найменування галузі знань:**  05 «Соціальні та поведінкові науки» | | | | **Цикл дисциплін за навчальним планом:**  Цикл професійної та практичної підготовки | | | |
| **Код та назва спеціальності:**  051 «Економіка» | | | | **Освітній ступінь:**  бакалавр | | | |
| **Спеціалізація:**  «ІТ в бізнесі» | | | |  | | | |
| **Курс:** \_\_\_\_\_\_3\_\_\_\_\_\_\_\_  **Семестр:** \_\_\_\_\_6\_\_\_\_\_\_ | | | | **Методи навчання:**  Лекції, лабораторні заняття, самостійна робота, робота в бібліотеці, Інтернеті тощо. | | | |
|  | | | |  | | | |
| **Кількість кредитів**  **ECTS** | **Кількість годин** | **Кількість аудитор-них годин** | **Лекції** | **Семіна-ри, прак-тичні,**  **лабора-торні** | **Заліки по модулях/іспит**  **(контро-льні**  **роботи)** | **Самостійна робота студента**  **(СРС)** | **Індивіду-альна робота**  **студента**  **(ІНДЗ)** |
| 4 | 120 | 80 | 32 | 48 | 6 | 40 | - |
| **Кількість**  **тижневих годин** | | **Кількість змістових модулів (тем)** | | **Кількість заліків по модулях /конт-рольних робіт** | | **Вид контролю** | |
| 5 | | 8 | | - | | ПМК, іспит | |

Примітка: співвідношення кількості годин аудиторних занять та самостійної і індивідуальної роботи визначена у робочому навчальному плані

**3. Тематичний план НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ**

|  |  |
| --- | --- |
| Номер теми | Назва теми |
| 1 | Ризик як економічна категорія ринкової економіки. Концептуальні засади ризикології в економіці та підприємництві. |
| 2 | Диверсифікація ризику при прийнятті рішень на різних рівнях економічного управління |
| 3 | Загальні методи вимірювання ризику |
| 4 | Теорія корисності та прийняття рішень в умовах ризику |
| 5 | Система кількісних оцінок економічного ризику |
| 6 | Оцінка ризику з використанням апарату марківських випадкових процесів |
| 7 | Прийняття рішень із застосуванням дерева рішень |
| 8 | Ризик і теорія ігор. Експертні оцінки виміру ризику |

1. **Зміст НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ**

**Тема 1. Ризик як економічна категорія ринкової економіки**

Ризик – невід'ємний елемент ринкових відносин. Місце і роль економічного ризику в системах керування різних рівнів ієрархії. Історія виникнення поняття "господарський ризик", підходи до його вивчення. Мета й основні завдання вивчення дисципліни "Теорія економічного ризику". Об'єктивність постановки проблеми економічного ризику, його суть. Поняття визначеність, ризик, невизначеність, їхні якісні відмінності. Прийняття управлінських рішень в умовах визначеності, ризику і невизначеності. Ситуації, зв'язані з ризиком. Поняття економічний ризик, об'єкт і суб'єкт ризику. Об'єктивні і суб'єктивні джерела виникнення ризику. Аналіз ситуацій виникнення ризиків. Причини виникнення максимального ризику. Політика керування ризиком, її роль у цілеспрямованому розвитку підприємства (фірми). Визначення стратегії ризику, його границь (діапазонів), оцінка ризику – основні напрями політики керування ризиком. Принципи керування ризиком.

**Тема 2. Диверсифікація ризику при прийнятті рішень на різних рівнях економічного управління**

Класифікація ризиків за: рівнем економічного керування; тривалістю впливу ризику; сферою діяльності виробника; характером прояву; систематичністю впливу. Аналіз спектра ризиків, що впливають на діяльність виробників. Зовнішні і внутрішні ризики виробників. Категорії страхового, валютного і ризику форсмажорних обставин. Внутрішні економічні ризики як відображення діяльності суб'єктів, що хазяюють. Поняття систематичних ризиків: ризик інфляції, зміни процентних ставок, падіння загально-ринкових цін. Сутність несистематичних ризиків; галузевий ризик і фінансовий. Історія виникнення теорій ризику. Диверсифікованість ризику за стадіями життєвого циклу.

**Тема 3. Загальні методи вимірювання ризику**

Методи виміру ризику. Класифікація методів: загальні і спеціальні; кількісні та якісні. Загальні методи виміру економічного ризику. Статистичний метод. Крива Лоренца і спосіб її побудови. Оцінка ризику за допомогою формули Маслова. Класифікація діапазонів ризику. Поняття і формування діапазонів ризику. Аналітичний метод виміру ризику. Показники періоду окупності, чистого приведеного доходу, індексу рентабельності та норми прибутковості. Аналіз чутливості моделі. Аналіз величини відносних ризиків. Метод аналогій. Вивчення життєвого циклу проектів.

**Тема 4. Теорія корисності та прийняття рішень в умовах ризику**

Вибір в умовах ризику. Ризик у загальній статистичній теорії прийняття рішень. Фактори, що впливають на величину ризику при прийнятті рішень. Дерево рішень, його побудова. Визначення доцільного управлінського рішення за допомогою дерева рішень. Концепція корисності фон Неймана-Моргенштерна. Основні аксіоми: аксіома транзитивності, аксіома незалежності, аксіома раціональності, аксіома байдужості. Побудова функції корисності ЛПР на основі його відношення до ризику. Максимізація очікуваної корисності. Аналіз ризику за допомогою функції корисності.

**Тема 5*.* Система кількісних оцінок економічного ризику**

Кількісна оцінка як основа для використання статистичних методів виміру економічного ризику. Загальні підходи до кількісної оцінки ризику в спектрі економічних проблем. Основні категорії ризику. Рівень ризику і ризик часу. Відносні оцінки ризику: премія за ризик, мінливість очікуваних результатів. Імовірність настання події – основа кількісної оцінки ризику. Об'єктивна і суб'єктивна імовірності. Критерії вибору ступеня ризику. Абсолютні оцінки ризику; дисперсія результатів, стандартне відхилення. Визначення форми розподілу характеристик економічних процесів. Коефіцієнт ризику, характер його змін. Основні властивості коефіцієнта ризику, діапазон його змін. Емпіричне визначення коефіцієнта ризику.

**Тема 6. Оцінка ризику з використанням апарату марківських випадкових процесів**

Дослідження марківських процесів через поняття „випадкова величина” та „випадковий процес”. Марківський процес та поняття марківської властивості. Основи теорії ланцюгів Маркова. Ланцюги Маркова. Марківська задача прийняття рішень. Марківські процеси прийняття рішень. Зміст поняття "стан системи". Класифікація станів: достовірне, неможливе, випадкове. Поняття елементарний стан, частка виникнення стану. Якості ймовірності станів. Виникнення теорії марківських процесів. Поняття випадкового процесу. Поняття марківського процесу. Класифікація марківських проце-сів. Характеристики марківського процесу з дискретними станами та дискретним часом. Матриця перехідних ймовірностей. Однорідний марківський ланцюжок. Характеристика марківського процесу з дискретними станами та безперервним часом. Поняття перехідних ймовірностей та щільності ймовірностей переходу зі стану в стан. Однорідний та неоднорідний безперервний марківський ланцюжок.

**Тема 7. Прийняття рішень із застосуванням дерева рішень**

Еволюційні математичні методи та моделі аналізу і прогнозування економічних змін. Математичні методи і моделі аналізу процесів інноваційного розвитку підприємства Граф станів. [метод побудови дерева рішень](https://www.google.com.ua/url?sa=t&rct=j&q=&esrc=s&source=web&cd=4&cad=rja&uact=8&ved=2ahUKEwjBupD3v4XdAhVKjiwKHUPUBZMQFjADegQIBxAB&url=http%3A%2F%2Fp-for.com%2Fbook_408_glava_64_METOD_POBUDOVI_DEREVA_R%25D0%2586SHEN_.html&usg=AOvVaw0dj7FWtwDYYezGIGpZwa2H). [Оцінка ризику за допомогою дерева рішень](https://www.google.com.ua/url?sa=t&rct=j&q=&esrc=s&source=web&cd=6&cad=rja&uact=8&ved=2ahUKEwjBupD3v4XdAhVKjiwKHUPUBZMQFjAFegQIAxAB&url=http%3A%2F%2Fstudopedia.com.ua%2F1_238415_otsinka-riziku-za-dopomogoyu-dereva-rishen.html&usg=AOvVaw1sO-KmfX3cUbVOFFCdSnFz).

**Тема 8. Ризик і теорія ігор. Експертні оцінки виміру ризику**

Предмет теорії ігор. Поняття конфлікту. Класифікація ігор. Скінченні та нескінченні ігри. Антагоністичні ігри, ігри з нульовою сумою, ігри з постійною різницею. Кооперативні та некооперативні ігри.

Поняття платіжна матриця. Нижча та верхня ціна ігри. Ігри з сідловою точкою. Вибір оптимальної стратегії в простій антагоністичній грі. Ризик в іграх з природою. Критерії прийняття оптимальних рішень: Лапласа, Вальда, Гурвіца, Севіджа, Байєса, Ходжеса-Лемана. Вибір оптимальної стратегії розвитку фірми в умовах ризику і невизначеності. Класифікація експертних методів та моделей. Індивідуальні та колективні експертні оцінки. Типи групових процедур. Зміст методів "мозкового штурму", "Делфі" та методу сценаріїв. Загальна схема експертизи. Підготовка експертизи. Типи експерт-них питань. Вимоги до формування експертної групи. Методи відбору експертів. Методи обробки експертної інформації: статистичні методи, алгебраїчні методи та ін. Оцінка погодженості думок експертів. Коефіцієнт конкордації.

**5. СПИСОК РЕКОМЕНДОВАНОЇ ЛІТЕРАТУРИ:**

1. Балабанов И. Т. Риск-менеджмент / И. Т. Балабанов. – М. : Финансы и статистика, 1996. – 156 с. Бережная Е. В. Математические методы моделирования экономических систем : учебн. пособ. / Е. В.Бережная, В. И. Бережной. – М. : Финансы и статистика, 2002. – 368 с.
2. Вітлінський В. В. Аналіз, оцінка і моделювання економічного ризику / В. В. Вітлінський. – К. : ДЕМІУР, 1996. – 212 с.
3. Вітлінський В. В. Ризик у менеджменті / В. В. Вітлінський, С. І. На- конечний. – К. : ТОВ "Бори сфен-М", 1996. – 326 с.
4. Вітлінський В. В. Ризикологія в економіці та підприємництві : Монографія / В. В. Вітлінський, Г. І. Великоіваненко. – К. : КНЕУ, 2002. – 490 с.
5. Гранатуров В. М. Экономический риск: сущность, методы измерения, пути снижения / В. М. Гранатуров. – М. : Изд. "Дело и Сервис", 1999. – 112 с.
6. Клебанова Т. С. Теория экономического риска : учебн. пособ. / Т. С. Клебанова, Е. В. Раевнева. – Х. : Издательский Дом "ИНЖЕК", 2006. – 208 с.
7. Робоча програма навчальної дисципліни "Теорія економічного ризику" для студентів напряму підготовки 6.030506 "Прикладна статистика" денної форми навчання / уклад. О. В. Раєвнєва, О. І. Бров-ко. – Х. : ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2015. – 48 с. (Укр. мов.).
8. Ястремський О. І. Моделювання економічного ризику / О. І. Яст- ремський. – К. : Либідь, 1992. – 80с.
9. Клебанова Т. С. Теория экономического риска : учебн. пособ. / Т. С. Клебанова, Е. В. Раевнева. – Х. : Изд. ХГЭУ, 2001. – 132 с.
10. Клебанова Т. С. Теория экономического риска : учебн. пособ. для самостоятельного изучения дисциплины / Т. С. Клебанова, Е. В. Раевнева. – Х. : Издательский Дом "ИНЖЕК", 2003. – 272 с.
11. Клебанова Т. С. Теория экономического риска : учебн. пособ. – 2-е изд., перераб. и доп./ Т. С. Клебанова, Е. В. Раевнева. – Х. : Издательский Дом "ИНЖЕК", 2007. – 208 с.

***Додаткова:***

1. Альгин А. П. Риск и его роль в общественной жизни / А. П. Альгин. – М. : Мысль, 1989. – 188 с. Гончаров І. В. Ризик та прийняття управлінських рішень: навч. посіб. / І. В. Гончаров. – Х. : НТУ "ХПІ", 2003. – 150 с.
2. Грабовый П. Г. Риски в современном бизнесе / П. Г. Грабовый, С. Н. Петрова. – М. : Изд. "Аланс", 1994. – 200 с.
3. Ермольев Ю. М. Методы стохастического программирования / Ю. М. Ермольев. – М. : Наука, 1976. – 312 с.
4. Канторович Л. В. Экономика и оптимизация / Л. В. Канторович. – М. : Наука,1990. – 212 с.
5. Кини Р. Л. Принятие решений при многих критериях: пред- почтения и замещения / Р. Л. Кини, Х. Райфа. – М. : Мир, 1982. – 132 с.
6. Клебанова Т. С. Теория экономического риска : учебн. пособ. / Т. С. Клебанова, Е. В. Раевнева. – Х. : Изд. ХГЭУ, 2001. – 132 с.
7. Моррис У. Т. Наука об управлении. Байесовский подход / У. Т. Мор- рис. – М. : Мир, 1971. – 152 с.
8. Петраков Н. Я. Фактор неопределенности и управление экономичес- кими системами / Н. Я. Петраков, В. И. Ротарь. – М. : Наука, 1985. – 116 с.
9. Райзенберг Б. А. Предпринимательство и риск / Б. А. Райзенберг. – М. : Знание, 1992. – 56 с.
10. Фон Нейман Д. Теория игр и экономическое поведение / Д. Фон Нейман, О. Моргенштерн. – М. : Наука, 1970. – 707 с.
11. Харрис Дж. Денежная теория / Дж. Харрис. – М. : Мир, 1977. – 368 с.
12. Хозяйственный риск и методы его измерения / под ред. Т. Бач- каи. – М. : Экономика, 1979. – 184 с.
13. Четыркин Е. М. Методы финансовых и коммерческих расчетов / Е. М. Четыркин. – М. : Дело, 1993. – 88 с.

**6. ГРАФІК РОЗПОДІЛУ НАВЧАЛЬНОГО ЧАСУ ЗА ОСВІТНЬОЮ ПРОГРАМОЮ ТА ВИДАМИ НАВЧАЛЬНОЇ РОБОТИ**

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| №  теми | Назва розділів, тем | Кількість  годин за ОПП | | | Розподіл аудиторних годин | | |
| **Всього** | у т.ч. | |
| СРС | аудиторні заняття | лекції | лабораторні заняття | контр./заліки  по модулях |
| **1** | 2 | **3** | **4** | **5** | **6** | **7** | **8** |
| **Заліковий модуль 1** | | | | | | | |
| 1 | Ризик як економічна категорія ринкової економіки | 13 | 5 | 8 | 4 | 4 | -/- |
| 2 | Диверсифікація ризику при прийнятті рішень на різних рівнях економічного управління | 13 | 5 | 8 | 4 | 4 | -/- |
| 3 | Загальні методи вимірювання ризику | 15 | 5 | 10 | 4 | 6 | -/- |
| 4 | Теорія корисності та прийняття рішень в умовах ризику | 15 | 5 | 10 | 4 | 6 | -/- |
| 5 | Система кількісних оцінок економічного ризику | 13 | 5 | 8 | 4 | 4 | -/- |
| 6 | Оцінка ризику з використанням апарату марківських випадкових процесів | 17 | 5 | 12 | 4 | 8 | -/- |
| 7 | Прийняття рішень із застосуванням дерева рішень | 17 | 5 | 12 | 4 | 8 | -/- |
| 8 | Ризик і теорія ігор. Експертні оцінки виміру ризику | 17 | 5 | 12 | 4 | 8 | -/- |
| **Разом** | | **120** | **40** | **80** | **32** | **48** | **-/-** |

**7. КАЛЕНДАРНО-ТЕМАТИЧНИЙ ПЛАН АУДИТОРНИХ ЗАНЯТЬ**

**7.1. Календарно-тематичний план лекційних занять**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **№ за­нят­тя** | **Тема та короткий зміст заняття** | **К-ть****годин** |
| *1* | 2 | 3 |
|  | **Заліковий модуль №1** | **16** |
| 1 | Ризик як економічна категорія ринкової економіки | 4 |
| 2 | Диверсифікація ризику при прийнятті рішень на різних рівнях економічного управління | 4 |
| 3 | Загальні методи вимірювання ризику | 4 |
| 4 | Теорія корисності та прийняття рішень в умовах ризику | 4 |
| 5 | Система кількісних оцінок економічного ризику | 4 |
| 6 | Оцінка ризику з використанням апарату марківських випадкових процесів | 4 |
| 7 | Прийняття рішень із застосуванням дерева рішень | 4 |
| 8 | Ризик і теорія ігор. Експертні оцінки виміру ризику | 4 |
|  | **Разом годин** | **32** |

**7.2. Календарно-тематичний план лабораторних занять, заліків по модулях, контрольних робіт**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **№ Заняття** | **Тема** | **К-ть** **годин** |
| *1* | 2 | 3 |
|  | **Заліковий модуль №1** | **16** |
| 1 | Ризик як економічна категорія ринкової економіки | 4 |
| 2 | Диверсифікація ризику при прийнятті рішень на різних рівнях економічного управління | 4 |
| 3 | Теорія корисності та прийняття рішень в умовах ризику | 6 |
| 4 | Система кількісних оцінок економічного ризику | 6 |
| 5 | Оцінка ризику з використанням апарату марківських випадкових процесів | 4 |
| 6 | Прийняття рішень із застосуванням дерева рішень | 8 |
| 7 | Загальні методи вимірювання ризику. Ризик і теорія ігор. Експертні оцінки виміру ризику | 4 |
| 8 | Загальні методи вимірювання ризику. Ризик і теорія ігор. Експертні оцінки виміру ризику | 4 |
|  | **Разом годин** | **48** |

**7.3. Графік консультацій**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **№ п/п** | **Зміст консультації** | **Кількість годин** |
| 1 | Оцінка ризику з використанням апарату марківських випадкових процесів | 1 |
| 2 | Ризик і теорія ігор. Експертні оцінки виміру ризику | 2 |
| **РАЗОМ** | | **2** |

Плани ЛАБОРАТОРНИХ занять

Плани лабораторних занять видаються окремими брошурами в розрізі тем навчальної дисципліни.

**8. САМОСТІЙНА РОБОТА СТУДЕНТІВ (СРС)**

**8. 1. ГРАФІК САМОСТІЙНОЇ РОБОТИ СТУДЕНТІВ**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **№ розділу, теми** | Назва розділу, теми | **Кіль­кість годин СРС** |
| Тема 1 | Ризик як економічна категорія ринкової економіки | 5 |
| Тема 2 | Диверсифікація ризику при прийнятті рішень на різних рівнях економічного управління | 5 |
| Тема 3 | Теорія корисності та прийняття рішень в умовах ризику | 5 |
| Тема 4 | Система кількісних оцінок економічного ризику | 5 |
| Тема 5 | Оцінка ризику з використанням апарату марківських випадкових процесів | 5 |
| Тема 6 | Прийняття рішень із застосуванням дерева рішень | 5 |
| Тема 7 | Загальні методи вимірювання ризику | 5 |
| Тема 8 | Ризик і теорія ігор. Експертні оцінки виміру ризику | 5 |
|  | **Разом** | **40** |

9. Методи оцінювання знань студентів

Оцінювання рівня знань студентів проводиться за модульно-рейтинговою системою.

**Нарахування балів відбувається під час:**

* здачі лабораторних робіт (9 оцінювань ЛРx5 балів – 9\*5=45);
* захисту звіту про виконану самостійну роботу (оцінювання СРСx5 балів – 1\*5=5);
* складання іспиту – 50 балів.

**9.1. Таблиця оцінювання (визначення рейтингу) навчальної діяльності студентів**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Поточний модульний контроль | | СРС | Разом-100 балів |
| Лабораторні заняття | Е |
| 45 | 50 | 5 | 100 |

Результат поточного контролю освітньої діяльності студентів за семестр визначається як середнє арифметичне з поточних балів за 5-бальною шкалою, відображених у журналах обліку відвідування та успішності, помножену на коефіцієнт 10.

9.2. Система нарахування рейтингових балів та критерії оцінювання знань студентів

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **№ п/п** | **Види робіт** | **Бали рейтингу** | **Макси­мальна к‑сть** |
| **1.** | **Критерії оцінки лабораторних робіт** | **від 0 до 5 балів** | **45** |
|  | Робота виконана у зазначений термін, у повному обсязі, без помилок і зарахована | **5** |  |
|  | Робота виконана у зазначений термін, у повному обсязі, зарахована, але є помилки | **4** |  |
|  | Робота виконана у неповному обсязі, або з порушенням терміну виконання, або при наявності значних помилок | **2** |  |
|  | Виконання пропущеної роботи або повторне виконання не зарахованої роботи | **½ від попередніх критеріїв** |  |
|  | Робота не виконана або не зарахована | **0** |  |
| **2.** | **Оцінювання самостійної роботи** | **від 0 до 5 балів** | **5** |
|  | - зроблене повністю та зданий вчасно звіт | **max к-ть** |  |
|  | - зроблене не повністю, з помилками чи неякісно оформлений звіт | **від 0 до max** |  |
|  | - здані з порушенням терміну | **½ від попередніх критеріїв** |  |
| **5.** | **Критерії оцінювання екзамену** |  | **50** |
|  | Завдання І рівня призначені для перевірки основних знань з предмету та вимагають вибору правильної відповіді чи відповідей із запропонованих варіантів | **20** |  |
|  | Завдання ІІ рівня потребують детального аналізу поставленого питання та вибору правильної відповіді чи відповідей із запропонованих варіантів (завдання з короткою відповіддю) | **15** |  |
|  | Завдання ІІІ рівня потребують виконання поданих завдань (практичне завдання) | **15** |  |

Контроль знань і умінь студентів з навчальної дисципліни здійснюється згідно з кредитно-модульною системою організації навчального процесу.

Оцінювання знань студентів з навчальної дисципліни “Економічні ризики та методи їх вимірювання” здійснюється на основі поточного та проміжного контролю та складання екзамену за 100-бальною шкалою.

Результат поточного контролю освітньої діяльності студентів за семестр визначається як середнє арифметичне з поточних балів за 5-бальною шкалою, відображених у журналах обліку відвідування та успішності, помножену на коефіцієнт 10.

**10. Методичне забезпечення дисципліни**

**10.1. Методичне забезпечення дисципліни**

Методичне забезпечення, яке супроводжує викладання дисципліни:опорні конспекти лекцій; інтерактивний комплекс навчально-методичного забезпечення дисципліни (ІКНМЗД); ілюстративні матеріали тощо.

**10.2. Методики активізації процесу навчання**

вказати які методики активізації навчального процесу застосовуються на **кожному** занятті (лекційному чи семінарському/практичному)

**Проблемні лекції** направлені на розвиток логічного мислення студентів. Коло питань теми обмежується двома-трьома ключовими моментами. Студентам під час лекцій роздається друкований матеріал, виділяються головні висновки з питань, що розглядаються. При читанні лекцій студентам даються питання для самостійного обмірковування. Студенти здійснюють коментарі самостійно або за участю викладача.

**Робота в малих групах** дає змогу структурувати семінарські заняття за формою і змістом, створює можливості для участі кожного студента в роботі за темою заняття, забезпечує формування особистісних якостей та досвіду спілкування.

**Семінари-дискусії** передбачають обмін думками і поглядами учасників з приводу даної теми, а також розвивають мислення, допомагають формувати погляди і переконання, виробляють вміння формулювати думки й висловлювати їх, вчать оцінювати пропозиції інших людей, критично підходити до власних поглядів.

**Мозкові атаки** – метод розв’язання невідкладних завдань, сутність якого полягає в тому, щоб висловити якомога більшу кількість ідей за дуже обмежений проміжок часу, обговорити і здійснити їх селекцію

**Кейс-метод** – розгляд, аналіз конкретних ситуацій, який дає змогу наблизити процес навчання до реальної практичної діяльності.

**Презентації** – виступи перед аудиторією, що використовуються; для представлення певних; досягнень, результатів роботи групи, звіту про виконання індивідуальних завдань тощо.

**Банки візуального супроводження** сприяють активізації творчого сприйняття змісту дисципліни за допомогою наочності:

* Законодавчі матеріали та коментарі до них
* Навчально-методичні матеріали з вивчення навчальної дисципліни
* Інтерактивні посібники, підручники
* Періодичні видання.

1. РЕСУРСИ МЕРЕЖІ ІНТЕРНЕТ
2. Офіційний сайт державної служби статистики України. – Режим доступу : http://www.ukrstat.gov.ua/.
3. Офіційний сайт департаменту статистики Організації Об'єднаних Націй. – Режим доступу : <http://unstats.un.org/unsd/default.htm>.
4. Офіційний сайт Міжнародного валютного фонду. – Режим доступу : <http://www.imf.org>.
5. Офіційний сайт Міністерства економічного розвитку та торгівлі України. – Режим доступу : <http://me.kmu.gov.ua>.
6. Офіційний сайт Національного банку України. – Режим доступу : <http://www.bank.gov.ua>.
7. Офіційний сайт Світового банку. – Режим доступу : <http://web.worldbank.org>.
8. Офіційний сайт Світового економічного форуму. – Режим доступу : <http://www.weforum.org>.
9. Офіційний сайт Статкомітета СНД. – Режим доступу : <http://www.cisstat.com>.
10. Офіційний сайт Фонду миру. – Режим доступу : <http://www.fundforpeace.org/global>.
11. Асоціація Українських Банків [Електронний ресурс]. – Режим доступу : http://aub.org.ua.