



Кафедра цифрової економіки та
бізнес-аналітики

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ЛЬВІВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ІМЕНІ ІВАНА ФРАНКА



доц. Стасишин А. В.
2022 р.

**РОБОЧА
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 2022

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


"__" _____ 2022 року – 24 с.

Розробник: Васьків О. М., ст. викладач кафедри цифрової економіки та бізнес-аналітики

Розглянуто та ухвалено на засіданні кафедри цифрової економіки та бізнес-аналітики

Протокол № 1 від "31" серпня 2022 р.

Завідувач кафедри


_____ (підпис)

Шевчук І. Б.

(прізвище, ініціали)

Розглянуто та ухвалено Вченою радою факультету управління фінансами та бізнесу

Протокол № 1 від "31" серпня 2022 р.

© Васьків О. М., 2022 рік

© ЛНУ імені Івана Франка, 2022 рік

ЗМІСТ

1. ПОЯСНЮВАЛЬНА ЗАПИСКА.....	4
2. ТЕМАТИЧНИЙ ПЛАН НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ.....	7
3. ЗМІСТ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ.....	8
4. СПИСОК РЕКОМЕНДОВАНОЇ ЛІТЕРАТУРИ.....	10
5. ГРАФІК РОЗПОДІЛУ НАВЧАЛЬНОГО ЧАСУ ЗА ТЕМАМИ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ ТА ВИДАМИ НАВЧАЛЬНОЇ РОБОТИ.....	14
6. КАЛЕНДАРНО-ТЕМАТИЧНИЙ ПЛАН АУДИТОРНИХ ЗАНЯТЬ.....	15
6.1. КАЛЕНДАРНО-ТЕМАТИЧНИЙ ПЛАН ЛЕКЦІЙНИХ ЗАНЯТЬ.....	15
6.2. КАЛЕНДАРНО-ТЕМАТИЧНИЙ ПЛАН ЛАБОРАТОРНИХ ЗАНЯТЬ ТА ЗАЛКОВИХ МОДУЛІВ.....	15
6.3. ГРАФІК ОBOB'ЯЗКОВИХ КОНСУЛЬТАЦІЙ.....	16
7. ПЛАНИ ЛАБОРАТОРНИХ ЗАНЯТЬ.....	16
8. САМОСТІЙНА РОБОТА СТУДЕНТІВ (СРС).....	17
9. МЕТОДИ ОЦІНЮВАННЯ ЗНАНЬ СТУДЕНТІВ.....	18
10. МЕТОДИЧНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ ДИСЦИПЛІНИ.....	20
11. МЕТОДИКИ АКТИВІЗАЦІЇ ПРОЦЕСУ НАВЧАННЯ.....	20
12. РЕСУРСИ МЕРЕЖІ ІНТЕРНЕТ.....	23
13. ЗМІНИ ТА ДОПОВНЕННЯ ДО РОБОЧОЇ ПРОГРАМИ.....	24

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 проявлятися 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 «Інформаційні та комунікаційні технології», «Автоматизація бізнес-процесів», «Математика для економістів», «Економіко-математичне моделювання» та ін.

Вимоги до знань та умінь

При вивченні дисципліни «Економічні ризики та методи їх вимірювання» **здобувачі вищої освіти набувають такі компетентності (здатність):**

СК4 – Здатність пояснювати економічні та соціальні процеси і явища на основі теоретичних моделей, аналізувати і змістовно інтерпретувати отримані результати.

СК11 – Здатність обґрунтовувати економічні рішення на основі розуміння закономірностей економічних систем і процесів та із застосуванням сучасного методичного інструментарію.

СК14 – Здатність поглиблено аналізувати проблеми і явища в одній або декількох професійних сферах з врахуванням економічних ризиків та можливих соціально-економічних наслідків.

СК15 – Здатність використовувати пакети прикладних програм для аналізу та прогнозування соціально-економічних явищ, а також моделювання бізнес-процесів і результатів діяльності економічних об'єктів.

Програмні результати навчання:

ПР10 – Проводити аналіз функціонування та розвитку суб'єктів господарювання, визначати функціональні сфери, розраховувати відповідні показники які характеризують результативність їх діяльності.

ПР22 – Демонструвати гнучкість та адаптивність у нових ситуаціях, у роботі із новими об'єктами, та у невизначених умовах.

ПР26 – Визначати необхідні комп'ютерні програми та засоби візуальної аналітики для обробки великих масивів даних з метою виявлення нових закономірностей та тенденцій.

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 кількісний аналіз ризику проєктів;

- 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 вміня	Зміст критерію сформованості вміня
Репродуктивний	Вміння відтворювати знання, передбачені цією програмою
Алгоритмічний	Вміння використовувати у практичній діяльності знання при розв'язуванні типових ситуацій
Творчий	Здійснювати евристичний 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: Нормативні навчальні дисципліни			
Код та назва спеціальності: 051 «Економіка»				Освітній ступінь: бакалавр			
Спеціалізація: «ІТ в бізнесі»							
Курс: _____ 4 _____ Семестр: _____ 7 _____				Методи навчання: Лекції, лабораторні заняття, самостійна робота, робота в бібліотеці, Інтернеті тощо.			
Кількість кредитів ECTS	Кількість годин	Кількість аудиторних годин	Лекції	Семінари, практичні, лабораторні	Заліки по модулях/іспит (контрольні роботи)	Самостійна робота студента (СРС)	Індивідуальна робота студента (ІНДЗ)
4	120	64	32	32	5	56	-
Кількість тижневих годин		Кількість змістових модулів (тем)		Кількість заліків по модулях /контрольних робіт		Вид контролю	
4		9		-/1		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
2	Аналіз та методи оцінювання ризику
3	Прийняття рішення в умовах невизначеності та ризику
4	Прийняття управлінських рішень щодо формування інвестиційного портфеля в умовах ризику та невизначеності
5	Аналіз і оцінка ризиків у бізнесі
6	Метод аналізу ієрархій як технологія системного планування в умовах ризику
7	Технології управління ризиками
8	ІТ-ризик та їх зв'язок з бізнес-ризиками
9	Ризик і теорія ігор. Експертні оцінки виміру ризику

4. ЗМІСТ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Тема 1. Ризик як економічна категорія ринкової економіки

Ризик – невід'ємний елемент ринкових відносин. Поняття про ризик. Складові економічного ризику. Функції та джерела економічного ризику. Класифікація ризиків. Особливості економічного ризику в сучасних умовах діяльності суб'єкта господарювання.

Тема 2. Аналіз та методи оцінювання ризику

Види аналізу ризику та його складові. Фактори, що зумовлюють економічні ризики. Зони та рівні ризику. Взаємозв'язок прибутку і ризику. Методи оцінювання ризику.

Тема 3. Прийняття рішення в умовах невизначеності та ризику

Критерій песимізму (критерій Вальда, найбільшої обережності). Критерій оптимізму (критерій Севіджа, правило мінімакс). Критерій песимізму-оптимізму (критерій Гурвіца). Критерій Байеса-Лапласа. Критерій Лапласа. Критерій Ходжа-Лемана.

Тема 4. Прийняття управлінських рішень щодо формування інвестиційного портфеля в умовах ризику та невизначеності

Інноваційний розвиток підприємства. Моделі визначення характеристик інвестиційного портфеля. Модель Квазі-Шарпа.

Тема 5. Аналіз і оцінка ризиків у бізнесі

Способи моделювання управлінських рішень. Метод «дерева рішень». Оцінка альтернативних маркетингових стратегій через «платіжну матрицю». Властивості марківських процесів. Марківська задача прийняття рішень.

Тема 6. Метод аналізу ієрархій як технологія системного планування в умовах ризику

Методологічні основи індикативного планування. Індикатори оцінки фінансово-господарської діяльності підприємства. Метод аналізу ієрархій: математична формалізація.

Тема 7. Технології управління ризиками

Сутність і зміст управління ризиком. Формування стратегії управління ризиком. Система управління ризиками. Принципи управління ризиками. Загальна схема процесу управління ризиком. Мета і завдання розробки програми управління ризиками. Принципи управління ризиками. Управління ризиком бізнесу. Інформаційне забезпечення розроблення програми управління ризиком.

Тема 8. IT-ризик та їх зв'язок з бізнес-ризиками

Поняття IT-ризик. Інформаційні технології: асоціальні фактори ризику. Актуальні завдання в розробці проблеми ризиків розвитку IT. Основні області IT-ризиків. IT-ризик та інформаційна безпека. Управління IT-ризиком. Обмеження для зниження ризику. Ризики безпеки в світлі бізнес-ризиків.

Тема 9. 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. 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. Балджи М.Д. Економічний ризик та методи його вимірювання. Навчальний посібник. – Харків: Промарт, 2015. – 300 с.
2. Василенко М. Д., Слатвінська В. М. Т Теорія ризиків : навчально-методичні рекомендації (в допомогу до самостійної роботи для здобувачів вищої освіти ступеня бакалавра факультету кібербезпеки та інформаційних технологій) [Електронне видання]. / М. Д. Василенко, В. М. Слатвінська; кафедра кібербезпеки НУ «Одеська юридична академія». - Одеса : Фенікс, 2020. - 32 с. - Режим доступу: <http://dspace.onua.edu.ua/handle/11300/14523>
3. Васьків О.М. Стохастична модель оптимального використання ресурсів та інформаційна технологія її реалізації / О.М. Васьків // Праці Одеського політехнічного університету: науковий та науково-виробничий збірник. – Одеса. – 2012. – Вип. 2 (39). – С. 280-286.
4. Васьків О.М. Автоматизація процесу вибору оптимальної стратегії розвитку підприємства в умовах ринку та невизначеності / О.М. Васьків, В.В. Здрок // Науковий вісник Національного лісотехнічного університету України: збірник науково-технічних праць. – Львів: НЛТУ України. – 2013. Вип. 23.1. – С. 347-353.
5. Васьків О. М. Формування інвестиційного портфеля на основі моделі «Квазі-Шарпа» / О. М. Васьків // Науковий журнал у галузі економічних наук «Економіка. Управління. Інновації». – Житомир, 2017. – №2. Режим доступу: http://nbuv.gov.ua/UJRN/eui_2017_2_4.
6. Васьків О.М. IT-ризик як основне джерело бізнес-ризиків / Ю. І. Шевчук, О. М. Васьків // Polish journal of science. – 2019. – № 20. – С. 28-36. <http://repository.vsau.org/getfile.php/21198.pdf>.
7. Шевчук І. Б., Старух А. І., Васьків О. М. Технології управління бізнес-ризиками та експертні методи їх оцінки. *НАУКОВИЙ ЖУРНАЛ «БІЗНЕС ІНФОРМ»*. № 2. 2020 р. (505). URL: https://www.business-inform.net/article/?year=2020&abstract=2020_2_0_295_306&fbclid=IwAR3RM19OEhdy_V6qzvsuvBrc_e7a39TWPkX5YHTRquCX_LpByD_EIYDF0z4.
8. Вітлінський В.В. Комерційний кредитний ризик виробничого підприємства / В.В. Вітлінський, В.І. Скіцько // Актуальні проблеми економіки : науковий економічний журнал. – 2011. – № 7. – С. 106-115.
9. Вітлінський В.В. Концептуальні засади ризикології у фінансовій діяльності / В.В. Вітлінський / Фінанси України. – К. : Преса України, 2003. – № 3. – С. 3-9.
10. Донець Л.І. Економічні ризики та методи їх вимірювання: Навчальний посібник. — К.: Центр навчальної літератури, 2006. - 312 с.
11. Економічні ризики та методи їх вимірювання: Навчально-методичний комплекс дисципліни [Електронний ресурс] : навч. посіб. для студ. спеціальності 051 «Економіка», освітньої програми «Економіка бізнес-підприємства» / КП ім. Ігоря Сікорського; уклад. О.В. Кривда – Електронні

- текстові дані (1 файл: 558 Кбайт). – Київ : КПІ ім. Ігоря Сікорського, 2019. – 49 с.
12. Інформаційні технології в бізнесі. Частина 1: Навч. посіб. / [Шевчук І. Б., Старух А. І., Васьків О. М. та ін.]; за заг. ред. І. Б. Шевчук. Львів: Видавництво ННБК «АТБ», 2020. 535 с.
 13. Величко В. Етапи розробки бізнес-плану підприємства// Економіка України. – 2012. - № 5. - С. 42-48.
 14. Економіко-математичне моделювання: Навчальний посібник / За ред. О. Т. Іващука. – Тернопіль: ТНЕУ «Економічна думка», 2008. – 704 с.
 15. Кучеренко В.Р., Карпов В.А., Карпов А.В. Економічний ризик та методи його вимірювання: Навчальний посібник. – Одеса, 2011.
 16. Карпов В.А. Планування та аналіз підприємницьких проектів. – Одеса: ОНЕУ, 2014. – 243 с
 17. Економічний ризик: методи оцінки та управління [Текст] : 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.
 18. Класифікація видів економічної діяльності [Електронний ресурс]. – Режим доступу : http://kved.ukrstat.gov.ua/KVED2010/kv10_i.html.
 19. Лаврів Л. А. Бізнес-планування у діяльності організації: базові процедури та основні методичні підходи / Л. А. Лаврін // Інноваційна економіка. - 2013. - № 10. 26. Лаврів Л. А. Планування діяльності організації : навчальний посібник / Л.А. Лаврів. –Тернопіль : Крок, 2013. – 320 с.
 20. Івченко І.Ю. Моделювання економічних ризиків і ризикових ситуацій : [навч. посіб.] / І.Ю. Івченко. - К.: Центр учбової літератури, 2007. - 344 с.
 21. Камінський А.Б. Економічний ризик та методи його вимірювання / А.Б. Камінський. - К.: Козаки, 2002.-120с.
 22. Кігель В.Р. Методи і моделі підтримки прийняття рішень у ринковій економіці: [монографія] / В.Р.Кігель. - К.: ЦУЛ, 2003. - 202 с.
 23. Немченко В.В., Зеленьак В.В. Ризики інноваційно-інвестиційної діяльності підприємства. Економіка харчової промисловості. 2015. Т. 7. Вип. 4. С. 73-79.
 24. Письменна Т.В. Фінансові ризики в господарській діяльності підприємства. Вісник Запорізького національного університету. Економічні науки. 2015. № 3(27). С. 151-158.
 25. Свідерська А. Поняття та класифікація ризиків у зовнішньоекономічній діяльності підприємства. Галицький економічний вісник. 2014. Т. 46. № 3. С. 113-121.
 26. Нескородев С.М., Грачова О.О. Дослідження сутності управління фінансовими ризиками підприємства. Вісник економіки транспорту і промисловості. 2014. № 47. С. 132-136.

27. Бондар О.В. Ситуаційний менеджмент: навч. посіб. К.: Центр учбової літератури, 2010. 326 с.
28. Пікус Р.В. Управління фінансовими ризиками: навч. посіб. К.: Знання, 2010. 598 с.
29. Стрес-тестування підприємницької діяльності підприємства з використанням синергетичного методу оцінювання ризиків / В.Д. Данчук, Л.С. Козак, М.В. Данчук. Актуальні проблеми економіки. 2015. № 9(171). С. 189-198.
30. Семенютіна Т.В. Концептуальні основи формування національного стандарту ризик-менеджменту діяльності підприємств в Україні. Сталій розвиток економіки. 2013. № 4(21). С. 140-144.
31. Лакіза В.В. Ризик регулювання у процесі планування виробничо-господарської діяльності підприємства. Вісник Національного університету «Львівська політехніка». Менеджмент та підприємництво в Україні: етапи становлення і проблеми розвитку. 2015. № 819. С. 58-65.
32. Чекалова Н.Е. Особливості планування діяльності підприємства в умовах невизначеності та ризику. Бізнес-навігатор. 2014. № 2(34). С. 223-230.

Додаткова:

1. Василевич Л.Ф. Юртин І.І. Прийняття рішень за умов конфлікту та невизначеності середовища. Навчальний посібник – К. : Київ. ун-т ім. Б. Грінченка. 2013. 128с.
2. Василенко М.Д. Ризики: правова та інформаційна безпека. Правове життя сучасної України : у 3 т. : матеріали Міжнар. наук.- практ. конф. (м. Одеса, 15 трав. 2020 р.) / відп. ред. М. Р. Аракелян. – Одеса : Видавничий дім «Гельветика», 2020. Т. 2. С. 371- 374 (в співавторстві). 18) Василенко М.Д. Деякі питання ризиків (інформаційних ризиків) в контексті соціальної інженерії. Безпека та виклики сучасності: ризики та кібербезпека в період пандемії безпека в сучасному світі : матеріали II Всеукраїнської науково-практ. конф. (м. Одеса, 20 листоп. 2020 р.) / за ред. О. В. Дикого. Одеса : Видавничий дім «Гельветика», 2020. С. 53-58 (в співавторстві).
3. Вовк В.М. Оптимізаційні моделі економіки : навч. посібник / В.М. Вовк, Л.М. Зомчак. – Львів: ЛНУ імені Івана Франка, 2013. – 318 с. 3. Дацко М. В. Дослідження операцій в економіці: навч. посіб. / М. В. Дацко, М. М. Карбовник. – Л. : ПАІС, 2009. – 288 с. 4. Економіко-математичне моделювання: Навчальний посібник / За ред. О. Т. Іващука. – Тернопіль: ТНЕУ “Економічна думка”, 2008. – 704 с
4. Гончаров І. В. Ризик та прийняття управлінських рішень: навч. посіб. / І. В. Гончаров. – Х. : НТУ "ХП", 2003. – 150 с.
5. Васьків О. М. Управління бізнесом через структури ІТ-ризиків / О. М. Васьків // І Міжнародна науково-практична конференція «Сучасна парадигма публічного управління». – Львів, 2019. – С. 405-408.

<http://filos.lnu.edu.ua/wp->

[content/uploads/2019/11/Zbirnyk_tezy_LNU_2019_Paradyhma_PU.doc.pdf](http://filos.lnu.edu.ua/wp-content/uploads/2019/11/Zbirnyk_tezy_LNU_2019_Paradyhma_PU.doc.pdf)

6. Васьків О. М. ІТ-ризика та їх зв'язок з бізнес-ризиками / О. М. Васьків, Ю. І. Шевчук // II International Scientific Conference The Modern Economic Research: Theory, Methodology, Practice: Conference Proceedings, September 27th, 2019. Kielce, Poland: Baltija Publishing. 156 pages. . – С. 78-82.

7. Васьків О. М. Технології управління ІТ-ризиками: зб. тез звітної наук. конф. Львівського національного університету імені Івана Франка за 2019 рік (електронне видання) : Секція факультету управління фінансами та бізнесу, (Львів, 1-8 лютого 2020 р.). – Львів : ЛНУ ім. І. Франка, 2020. С. 106-111.

https://financial.lnu.edu.ua/wp-content/uploads/2020/10/ZBIRNYK_ZVITNA_KONF._2020.pdf?fbclid=IwAR29Oc9SSmnDM_OdP-7OhMJc7oZhldKUJ0VGYq119bXHdMH8ZiwDHu5bU4Q.

8. Клебанова Т. С. Теория экономического риска : учебн. пособ. / Т. С. Клебанова, Е. В. Раевнева. – Х. : Изд. ХГЭУ, 2001. – 132 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.		лекції	лабораторні заняття	контр./заліки по модулях	
			СРС	аудиторні заняття				
1	2	3	4	5	6	7	8	
Заліковий модуль 1								
1	Ризик як економічна категорія ринкової економіки	8	6	2	2	-		
2	Аналіз та методи оцінювання ризику	12	6	6	4	2		
3	Прийняття рішення в умовах невизначеності та ризику	14	6	8	2	6		
4	Прийняття управлінських рішень щодо формування інвестиційного портфеля в умовах ризику та невизначеності	16	6	10	4	6		
5	Аналіз і оцінка ризиків у бізнесі	19	7	12	4	6	2/-	
6	Метод аналізу ієрархій як технологія системного планування в умовах ризику	17	7	10	4	6		
7	Технології управління ризиками	10	6	4	4	-		
8	ІТ-ризик та їх зв'язок з бізнес-ризиками	10	6	4	4	-		
9	Ризик і теорія ігор. Експертні оцінки виміру ризику	14	6	8	4	4		
Разом		120	56	64	32	32	2/-	

6. КАЛЕНДАРНО-ТЕМАТИЧНИЙ ПЛАН АУДИТОРНИХ ЗАНЯТЬ

6.1. Календарно-тематичний план лекційних занять

№ за- нят- тя	Тема та короткий зміст заняття	К-ть годин
	Заліковий модуль №1	32
1	Ризик як економічна категорія ринкової економіки	2
2	Аналіз та методи оцінювання ризику	2
3	Прийняття рішення в умовах невизначеності та ризику	2
4	Прийняття управлінських рішень щодо формування інвестиційного портфеля в умовах ризику та невизначеності	4
5	Аналіз і оцінка ризиків у бізнесі	6
6	Метод аналізу ієрархій як технологія системного планування в умовах ризику	4
7	Технології управління ризиками	4
8	ІТ-ризик та їх зв'язок з бізнес-ризиками	2
9	Ризик і теорія ігор. Експертні оцінки виміру ризику	6
	Разом годин	32

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

№ Занят тя	Тема	К-ть годин
	Заліковий модуль №1	32
1	Ризик як економічна категорія ринкової економіки	2
2	Аналіз та методи оцінювання ризику	2
3	Прийняття рішення в умовах невизначеності та ризику	6
4	Прийняття управлінських рішень щодо формування інвестиційного портфеля в умовах ризику та невизначеності	6
5	Аналіз і оцінка ризиків у бізнесі	6
6	Метод аналізу ієрархій як технологія системного планування в умовах ризику	6
7	Технології управління ризиками	-
8	ІТ-ризик та їх зв'язок з бізнес-ризиками	-
9	Ризик і теорія ігор. Експертні оцінки виміру ризику	4
	Разом годин	32

6.3. Графік консультацій

№ п/п	Зміст консультації	Кількість годин
1	Математичні моделі антикризового індикативного планування методом аналізу ієрархій	3
2	Експертні оцінки виміру ризику	2
3	Передекзаменаційна консультація	2
РАЗОМ		7

7. 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	6
Тема 2	Аналіз та методи оцінювання ризику	6
Тема 3	Прийняття рішення в умовах невизначеності та ризику	6
Тема 4	Прийняття управлінських рішень щодо формування інвестиційного портфеля в умовах ризику та невизначеності	6
Тема 5	Аналіз і оцінка ризиків у бізнесі	7
Тема 6	Метод аналізу ієрархій як технологія системного планування в умовах ризику	7
Тема 7	Технології управління ризиками	6
Тема 8	ІТ-ризик та їх зв'язок з бізнес-ризиками	6
Тема 9	Ризик і теорія ігор. Експертні оцінки виміру ризику	6
	Разом	56

9. МЕТОДИ ОЦІНЮВАННЯ ЗНАТЬ СТУДЕНТІВ

Оцінювання рівня знань студентів проводиться за модульно-рейтинговою системою.

Нарахування балів відбувається під час:

- задачі лабораторних робіт (4 оцінювань ЛРх5 балів – $4*5=20$);
- захисту звіту про виконану самостійну роботу (оцінювання СРСх5 балів – $1*10=10$);
- тестовий контроль (2 оцінювання ТК*10 балів – $2*10=20$);
- іспит – 50 балів.

9.1. Таблиця оцінювання (визначення рейтингу) навчальної діяльності студентів

Поточний модульний контроль		Іспит	Разом-100 балів
Лабораторні заняття	ТК/СРС		
20	20/10	50	100

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	20
	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	10
	- 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 іспиту		50
	Завдання I рівня призначені для перевірки основних знань з предмету та вимагають вибору правильної відповіді чи відповідей із запропонованих варіантів	20	
	Завдання II рівня потребують детального аналізу поставленого питання та вибору правильної відповіді чи відповідей із запропонованих варіантів (завдання з короткою відповіддю)	15	
	Завдання III 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.

9.3. Шкала оцінювання успішності студентів за результатами підсумкового контролю

Оцінка за шкалою ECTS	Оцінка в балах	Оцінка за національною шкалою
A	90 – 100	Зараховано
B	81-89	
C	71-80	
D	61-70	
E	51-60	
FX	21-50	Не зараховано
F	0-20	з повторним вивченням курсу

Студенти, що отримали сумарний бал в межах від 21 до 50 за національною шкалою, отримують оцінку FX за шкалою ECTS та скеровуються на повторне складання заліку.

10. МЕТОДИЧНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ ДИСЦИПЛІНИ

Навчально-методичне та наукове забезпечення кредитно-модульної системи організації навчального процесу з навчальної дисципліни “Економічні ризики та методи їх вимірювання” включає:

- стандарти освіти (Освітньо-професійна програма);
- навчальні та робочі навчальні плани;
- силабус навчальної дисципліни;
- програму навчальної дисципліни;
- робочу програму навчальної дисципліни;
- навчально-методичні матеріали для проведення лекцій;
- плани лабораторних робіт та методичні матеріали з їх проведення;
- завдання для самостійної роботи студента і методичні рекомендації щодо їх виконання з навчальної дисципліни;
- засоби діагностики знань та умінь студентів (збірники тестових завдань);
- завдання для підсумкового модульного контролю;
- методичні, мультимедійні, опорні матеріали для лекційних, лабораторних занять;
- рекомендована література на поточний навчальний рік.

11. МЕТОДИКИ АКТИВІЗАЦІЇ ПРОЦЕСУ НАВЧАННЯ

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.

Використання навчальних технологій для активізації процесу навчання з дисципліни

Тема 1. Ризик як економічна категорія ринкової економіки	
Проблемні лекції	Проблемні питання: Особливості економічного ризику в сучасних умовах діяльності суб'єкта господарювання
Презентації	
Тема 2. Аналіз та методи оцінювання ризику	
Презентації	Зони та рівні ризику. Взаємозв'язок прибутку і ризику Методи оцінювання ризику
Тема 3. Прийняття рішення в умовах невизначеності та ризику	
Проблемні лекції	Проблемні питання: Критерій песимізму (критерій Вальда, найбільшої обережності) Критерій оптимізму (критерій Севіджа, правило мінімакс)
Тема 4. Прийняття управлінських рішень щодо формування інвестиційного портфеля в умовах ризику та невизначеності	
Проблемні лекції	Проблемні питання: Моделі визначення характеристик інвестиційного портфеля. Модель Квазі-Шарпа
Тема 5. Аналіз і оцінка ризиків у бізнесі	
Презентації	Марківська задача прийняття рішень
Тема 6. Метод аналізу ієрархій як технологія системного планування в умовах ризику	
Презентації	Метод аналізу ієрархій: математична

	формалізація
Тема 7. Технології управління ризиками	
Презентації	Система управління ризиками. Принципи управління ризиками. Загальна схема процесу управління ризиком
Тема 8. ІТ-ризик та їх зв'язок з бізнес-ризиками	
Презентації	Управління ІТ-ризиком. Обмеження для зниження ризику. Ризик безпеки в світлі бізнес-ризиків
Тема 9. Ризик і теорія ігор. Експертні оцінки виміру ризику	
Презентації	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

12. РЕСУРСИ МЕРЕЖІ ІНТЕРНЕТ

1. Антипенко І. В. Онтологічна основа феномену ризику в сучасних методологічних підходах зарубіжної ризикології. Державне управління: удосконалення та розвиток. 2019. № 1. – URL: <http://www.dy.nayka.com.ua/?op=1&z=1371> (дата звернення: 04.02.2021). DOI: 10.32702/2307-2156-2019.1.26
2. Класифікація ризиків <https://buklib.net/books/26510/>
3. Сутність поняття «фінансовий ризик» підприємства [http://ndipzir.org.ua/wp-content/uploads/2018/Ryga_07_12_2018/Ryga18\(15\).pdf](http://ndipzir.org.ua/wp-content/uploads/2018/Ryga_07_12_2018/Ryga18(15).pdf)
3. Теоретичні основи управління фінансовими ризиками https://nmetau.edu.ua/file/konspekt_lektsiy_upravlinnya_finansovimi_rizikami.pdf
4. Офіційний сайт державної служби статистики України. – Режим доступу : <http://www.ukrstat.gov.ua/>.
5. Офіційний сайт Міжнародного валютного фонду. – Режим доступу : <http://www.imf.org>.
6. Офіційний сайт Міністерства економічного розвитку та торгівлі України. – Режим доступу : <http://me.kmu.gov.ua>.
7. Офіційний сайт Національного банку України. – Режим доступу : <http://www.bank.gov.ua>.
8. Офіційний сайт Світового банку. – Режим доступу : <http://web.worldbank.org>.
9. Офіційний сайт Світового економічного форуму. – Режим доступу : <http://www.weforum.org>.
10. Офіційний сайт Статкомітета СНД. – Режим доступу : <http://www.cisstat.com>.
11. Асоціація Українських Банків [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <http://aub.org.ua>.

