****

### МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ

**ЛЬВІВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ ІМЕНІ ІВАНА ФРАНКА**

|  |
| --- |
| **ЗАТВЕРДЖУЮ** |
| **Декан****\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ доц. Стасишин А. В.** |
| **«\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 2021 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 2021**

**Кафедра цифрової економіки та бізнес-аналітики**

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.

“\_\_\_” \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 2021 року – 19 с.

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

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

Протокол №1 від “27” серпня 2021 р.

Завідувач кафедри \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ Шевчук І. Б.

 (підпис) (прізвище, ініціали)

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

Протокол № 1 від “30” серпня 2021 р.

© Васьків О. М., 2021 рік

© ЛНУ імені Івана Франка, 2021 рік

**ЗМІСТ**

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

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

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

4. СПИСОК РЕКОМЕНДОВАНОЇ ЛІТЕРАТУРИ……………………………...9

5. ГРАФІК РОЗПОДІЛУ НАВЧАЛЬНОГО ЧАСУ ЗА ТЕМАМИ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ ТА ВИДАМИ НАВЧАЛЬНОЇ РОБОТИ…………………………………………………………………………..11

6. КАЛЕНДАРНО-ТЕМАТИЧНИЙ ПЛАН АУДИТОРНИХ ЗАНЯТЬ……...11

6.1. КАЛЕНДАРНО-ТЕМАТИЧНИЙ ПЛАН ЛЕКЦІЙНИХ ЗАНЯТЬ………12

6.2. КАЛЕНДАРНО-ТЕМАТИЧНИЙ ПЛАН ЛАБОРАТОРНИХ ЗАНЯТЬ ТА ЗАЛІКОВИХ МОДУЛІВ………………………………………………………...12

6.3. ГРАФІК ОБОВ’ЯЗКОВИХ КОНСУЛЬТАТЦІЙ………………………….13

7. ПЛАНИ ЛАБОРАТОРНИХ ЗАНЯТЬ………………………………………..13

8. САМОСТІЙНА РОБОТА СТУДЕНТІВ (СРС)……………………………...14

9. МЕТОДИ ОЦІНЮВАННЯ ЗНАНЬ СТУДЕНТІВ…………………………..15

10. МЕТОДИЧНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ ДИСЦИПЛІНИ………………………...17

10.1. МЕТОДИЧНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ ДИСЦИПЛІНИ………………………17

10.2.МЕТОДИКИ АКТИВІЗАЦІЇ ПРОЦЕСУ НАВЧАННЯ……………….....17

11. РЕСУРСИ МЕРЕЖІ ІНТЕРНЕТ…………………………………………….18

**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», «Математика для економістів, «Інформатизація бізнес-процесів», «Економіко-математичне моделювання» та ін.

**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:**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 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 | 64 | 32 | 32 | 5 | 56 | - |
| **Кількість****тижневих годин** | **Кількість змістових модулів (тем)** | **Кількість заліків по модулях /конт-рольних 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-ризики та їх зв'язок з бізнес-ризиками |
| 9 | 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. 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 Байєса-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. ІТ-ризики та їх зв'язок з бізнес-ризиками**

Поняття ІТ-ризику. Інформаційні технології: асоціальні фактори ризику. Актуальні завдання в розробці проблеми ризиків розвитку ІТ. Основні області ІТ-ризиків. ІТ-ризики та інформаційна безпека. Управління ІТ-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. 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.
12. Ситник В. Ф. Засоби дейтамайнінгу для аналізу бізнесових рішень // Науково-практичний журнал «Науково-технічна інформація». — № 3. — 2002. — С. 60—64.
13. Ситник В. Ф., Ситник Н. В. Проблеми впровадження дейтамайнінгу в бізнесі/ Вчені записки: Наук. зб. — Вип. 6 . — К.: КНЕУ. 2004. — С. 58—64.

***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 | Кількістьгодин 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 | 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-ризики 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**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **№ за­нят­тя** | **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-ризики 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**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **№ Заняття** | **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 | 4 |
| 6 | Контрольна робота | 2 |
| 7 | Метод аналізу ієрархій як технологія системного планування в умовах ризику | 6 |
| 8 | Технології управління ризиками | - |
| 9 | ІТ-ризики та їх зв'язок з бізнес-ризиками | - |
| 10 | 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 | 1 |
| 2 | Експертні оцінки виміру ризику | 2 |
| **РАЗОМ** | **2** |

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-ризики та їх зв'язок з бізнес-ризиками | 6 |
| Тема 9 | Ризик і теорія ігор. Експертні оцінки виміру ризику | 6 |
|  | **Разом** | **56** |

9. Методи оцінювання знань студентів

Оцінювання рівня знань студентів проводиться за модульно-рейтинговою системою.

**Нарахування балів відбувається під час:**

* здачі лабораторних робіт (6 оцінювань ЛРx5 балів – 6\*5=30);
* захисту звіту про виконану самостійну роботу (оцінювання СРСx5 балів – 1\*10=10);
* контрольна робота – 10 балів;
* іспит – 50 балів.

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

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Поточний модульний контроль | Іспит | Разом-100 балів |
| Лабораторні заняття | КР/СРС |
| 30 | 10/10 | 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** | **30** |
|  | 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 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.

**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. <https://www.5.ua/ekonomika/eksperty-nazvaly-osnovni-ekonomichni-ryzyky-2019-roku-184946.html>.
3. Фінансово-економічні ризики розвитку України в умовах сучасної кризи. <http://soskin.info/news/2896.html>.
4. Економічні ризики та методи їх вимірювання: Метод. рекомендації до вивчення дисципліни, проведення практичних занять та виконання контрольної роботи для студ. за напрямом підготовки6.030601 «Менеджмент» денної та заочної форм навч. / Уклад.: І.В. Федулова, Н.С. Скопенко – К.: НУХТ, 2013. – 51 с. <https://studfiles.net/preview/5194793/>.
5. Управління інформаційними технологіями та ІТ-ризиками <https://www.ey.com/ua/uk/services/advisory/it>.
6. Офіційний сайт державної служби статистики України. – Режим доступу : http://www.ukrstat.gov.ua/.
7. Офіційний сайт департаменту статистики Організації Об'єднаних Націй. – Режим доступу : <http://unstats.un.org/unsd/default.htm>.
8. Офіційний сайт Міжнародного валютного фонду. – Режим доступу : <http://www.imf.org>.
9. Офіційний сайт Міністерства економічного розвитку та торгівлі України. – Режим доступу : <http://me.kmu.gov.ua>.
10. Офіційний сайт Національного банку України. – Режим доступу : <http://www.bank.gov.ua>.
11. Офіційний сайт Світового економічного форуму. – Режим доступу : <http://www.weforum.org>.
12. Офіційний сайт Статкомітета СНД. – Режим доступу : <http://www.cisstat.com>.
13. Асоціація Українських Банків [Електронний ресурс]. – Режим доступу : http://aub.org.ua.