

**МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ**  
**Львівський національний університет імені Івана Франка**  
**Факультет економічний**  
**Кафедра інформаційних систем у менеджменті**

**Затверджено**

На засіданні кафедри інформаційних систем у менеджменті  
Економічного факультету  
Львівського національного університету імені Івана Франка  
(протокол № від 30.08.2020 р.)

Завідувач кафедри Приймак В.І.

**Силабус з навчальної дисципліни**  
**«Аналіз і моделювання економічного ризику»,**  
**що викладається в межах ОПП бакалаврського рівня**  
**вищої освіти для здобувачів зі спеціальності 073“Менеджмент”,**  
**спеціалізація “Інформаційні системи у менеджменті”**

**Львів 2020 р.**

|  |   |
|--|---|
| <b>Назва дисципліни</b>  | <b>Аналіз і моделювання економічного ризику</b>   |
| <b>Адреса викладання дисципліни</b>                              |   |
| <b>Факультет та кафедра, за якою закріплена дисципліна</b>       | Економічний факультет<br>Кафедра інформаційних систем у менеджменті   |
| <b>Галузь знань, шифр та назва спеціальності</b>                 | Галузь знань 07 “Управління та адміністрування”<br>Спеціальність 073“Менеджмент”<br>Спеціалізація 073 (І) “Інформаційні системи в менеджменті”  |
| <b>Викладачі дисципліни</b>                                      | Прийма Світлана Степанівна, к.е.н., доцент  |
| <b>Контактна інформація викладачів</b>                           | Доц. Прийма С.С.<br>svitlana.pryima@lnu.edu.ua<br><a href="https://econom.lnu.edu.ua/employee/pryima-s-s">https://econom.lnu.edu.ua/employee/pryima-s-s</a>   |
| <b>Консультації з питань навчання по дисципліні відбуваються</b> | Можливі он-лайн консультації через Teams. Для погодження часу он-лайн консультацій слід писати на електронну пошту викладача.   |
| <b>Сторінка курсу</b>  | Moodle  |
| <b>Інформація про дисципліну</b>                                 | Значення курсу полягає в необхідності вивчення майбутніми менеджерами специфіки прийняття рішень в умовах невизначеності та ризику, основних аспектів поведінки суб’єкта при подоланні невизначеності та ризику, дослідження шляхів, способів і методів обґрунтування та оптимізації ризику з метою підвищення надійності господарської діяльності. Тому у курсі представлено основні засади якісного та кількісного аналізу ризику, способи оцінювання ризикових ситуацій, методи отримання кінцевого результату і вибору оптимальної стратегії в умовах невизначеності, конфлікту.              |
| <b>Коротка анотація дисципліни</b>                               | Дисципліна «Аналіз і моделювання економічного ризику» є вибірковою дисципліною з спеціальності 073“Менеджмент” для освітньої програми “Інформаційні системи в менеджменті”, яка викладається в 5 семестрі в обсязі 4 кредитів (за Європейською Кредитно-Трансферною Системою ECTS).   |
| <b>Мета та цілі дисципліни</b>                                   | Мета вивчення вибіркової дисципліни «Аналіз і моделювання економічного ризику» спрямована на оволодіння студентами термінології теорії ризиків, засобів оцінки ризиків і захисту від них.   |
| <b>Література для вивчення дисципліни</b>                        | Основна література:<br><ol style="list-style-type: none"> <li>1. Артими-Дрогомирецька З.Б. Економічний ризик: Навчальний посібник. - К.: Центр учбової літератури, 2013.- 316 с.</li> <li>2. Гринчуцька В. Моделювання ризиків в економіці та бізнесі – Тернопіль, ТНТУ імені І. Пулюя, 2014.- 88 с.</li> <li>3. Васильєва Т.А., Леонов С.В., Кривич Я.М. та ін. Економічний ризик: методи оцінки та управління – Суми : ДВНЗ “УАБС НБУ”, 2015. – 208 с.</li> <li>4. Балджи М. Д. Економічний ризик та методи його вимірювання. Навчальний посібник. – Харків: Промарт, 2015. – 300 с.</li> </ol> |

|                                      |  |
|--------------------------------------|--|
|                                      | <p>5. Мороз В.М., Мороз С.А. Ризик-менеджмент – Вид-во Кондор, 2019. – 140 с.</p> <p>Додаткова література:</p> <p>6. Донець Л.І. Економічні ризики та методи їх вимірювання. Навчальний посібник. / Л.І. Донець — К.: Центр навчальної літератури, 2006. - 312 с.</p> <p>7. Вітлінський В.В., Верченко П.І. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком. - К., 2000. - 295 с.</p> <p>8. Артими-Дрогомирецька З.Б., Романич І.Б. Економічний ризик: практикум. - Львів: Видавництво Тараса Сороки, 2008.-186 с.</p> <p>9. Кондрашихін А. Б., Пепа Т.В. Теорія та практика підприємницького ризику: Навчальний посібник. — К.: Центр учбової літератури, 2009. — 224 с.</p>  |
| <b>Обсяг курсу</b>                   | 48 годин аудиторних занять. З них 32 годин лекцій, 16 годин практичних занять та 72 годин самостійної роботи   |
| <b>Очікувані результати навчання</b> | <p>Після завершення цього курсу студент буде :</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Знати <ul style="list-style-type: none"> <li>- класифікацію ризиків у господарській діяльності;</li> <li>- шляхи ідентифікації ризиків;</li> <li>- причини виникнення ризиків;</li> <li>- шляхи мінімізації впливу ризиків на господарську діяльність;</li> <li>- алгоритм оцінки та обґрунтування ризиків;</li> <li>- методи оцінки ризиків;</li> <li>- існуючі принципи формування стратегій ризик - менеджменту.</li> </ul> </li> <li>• Вміти <ul style="list-style-type: none"> <li>- ідентифікувати ризики у господарській діяльності;</li> <li>- аналізувати та класифікувати ризики притаманні тому чи іншому виду діяльності;</li> <li>- проводити оцінку ризиків;</li> <li>- розробляти стратегії ризик-менеджменту для мінімізації впливу ризиків на господарську діяльність підприємств.</li> </ul> </li> </ul> |
| <b>Ключові слова</b>                 | Економічний ризик, невизначеність, ступінь ризику, корисність, лотерея, резерви, запаси, диверсифікація, моделювання, прийняття рішень   |
| <b>Формат курсу</b>                  | Очний  |
|                                      | Проведення лекцій, практичних занять та консультацій для кращого розуміння тем   |
| <b>Теми</b>                          | <p><b>Модуль 1. Оцінювання економічного ризику</b></p> <p>Тема 1. Ризик та його основні характеристики</p> <p>Тема 2. Система кількісних оцінок ступеня ризику</p> <p>Тема 3. Теорія корисності та прийняття рішень за умов ризику</p> <p><b>Модуль 2. Управління економічним ризиком</b></p> <p>Тема 4. Управління ризиком</p> <p>Тема 5. Диверсифікація як спосіб зниження ризику: елементи теорії портфеля</p> <p>Тема 6. Запаси, резерви як спосіб зниження ступеня ризику</p> <p>Тема 7. Моделювання економічного ризику та теорія ігор</p> <p>Тема 8. Ієрархічні моделі прийняття рішень</p> <p>Тема 9. Вартість, час та ризик.</p> <p>Тема 10. Фінансовий ризик-менеджмент</p>  |

|   |   |
|---|---|
| <b>Підсумковий контроль, форма</b>  | Залік в кінці семестру<br>комбінований  |
| <b>Пререквізити</b>   | Для вивчення курсу студенти потребують базових знань з дисциплін вища математика, теорія ймовірності і математична статистика, економіка, менеджмент, фінанси, достатніх для сприйняття категоріального апарату економічного ризику. Перелічені предмети допоможуть в оволодінні методологією і методикою побудови, аналізу та використання економіко-математичних методів, які враховують економічні ризики. |
| <b>Навчальні методи та техніки, які будуть використовуватися під час викладання курсу</b> | Презентації, лекції, групові проекти, реферати, дискусія  |
| <b>Необхідне обладнання</b>   | Вивчення курсу не потребує використання програмного забезпечення, крім загально вживаних програм і операційних систем.  |
| <b>Критерії оцінювання (окремо для кожного виду навчальної діяльності)</b>                | Оцінювання проводиться за 100-бальною шкалою. Бали нараховуються за наступним співвідношенням:<br><ul style="list-style-type: none"> <li>• практичні/самостійні тощо : максимальна кількість балів 70;</li> <li>• контрольні заміри (модулі): максимальна кількість балів 30.</li> </ul> Підсумкова максимальна кількість балів 100   |
| <b>Питання до заліку чи екзамену.</b>   | Перелік питань для проведення підсумкової оцінки знань розміщено у Moodle   |
| <b>Опитування</b>   | Анкету-оцінку з метою оцінювання якості курсу буде надано по завершенню курсу.  |