

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ  
ХАРКІВСЬКА НАЦІОНАЛЬНА АКАДЕМІЯ МІСЬКОГО ГОСПОДАРСТВА

**Ю.Ю.Леонт'єва, Т.І. Світлична**

**ПРОГРАМА І РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ  
“ЕКОНОМІЧНІ РИЗИКИ”**

(для студентів 3 курсу заочної форми навчання освітньо-кваліфікаційного рівня  
бакалавр, напряму підготовки 0501 – «Економіка і підприємництво», 6.030504  
«Економіка підприємства»

Робоча програма навчальної дисципліни «Економічні ризики» (для студентів 3 курсу заочної форми навчання за напрямом підготовки 0501 - “Економіка і підприємництво”, 6.030504 «Економіка підприємства»). / Укл.: Ю.Ю.Леонт’єва, Т.І.Світлична – Харків: ХНАМГ, 2009. – 19 с.

Укладачі: Ю.Ю.Леонт’єва, Т.І.Світлична

Програма побудована за вимогами кредитно-модульної системи організації навчального процесу і узгоджена з орієнтовною структурою змісту навчальної дисципліни, рекомендованою Європейською Кредитно-Трансферною Системою (ECTS).

Рекомендована для студентів економічних спеціальностей.

Рецензент: к.е.н., доцент кафедри економіки будівництва В.І.Пасічний

Затверджено на засіданні кафедри економіки підприємств міського господарства, протокол № 1 від 02.09.2009 р.

© Ю.Ю. Леонт’єва, Т.І. Світлична ХНАМГ, 2009

## ЗМІСТ

ПЕРЕДМОВА .....	4
1. ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ .....	5
1.1. Мета, предмет та місце дисципліни .....	5
1.2. Інформаційний обсяг (зміст) дисципліни .....	5
1.3. Освітньо-кваліфікаційні вимоги .....	6
1.4. Рекомендована основна навчальна література .....	7
1.5. Анотація програми навчальної дисципліни .....	8
2. РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ .....	10
2.1. Структура навчальної дисципліни .....	10
2.2. Тематичний план навчальної дисципліни .....	10
2.3. Розподіл часу за модулями і змістовими модулями та форми навчальної роботи студента .....	13
2.4. Розподіл часу самостійної навчальної роботи студента .....	14
2.5. Засоби контролю та структура залікового кредиту .....	16
2.6. Методи та критерії оцінювання знань .....	17
2.7. Інформаційно-методичне забезпечення .....	18

## ПЕРЕДМОВА

Функціонуючи в умовах ринку, суб'єкт господарювання в кожний момент часу поставлений в умови коли від нього вимагається прийняти певне рішення: розробити шлях досягнення певної мети. І оскільки детермінованих ситуацій в економіці практично не існує, такий підприємець не може на 100% бути впевненим, що обраний ним шлях приведе до поставленої мети, тобто підприємець постійно стикається із ситуацією невизначеності. Вивчення навчальної дисципліни «Економічні ризики» спрямовано для зменшення невизначеності в процесі прийняття управлінських рішень в господарській діяльності.

Дисципліна «Економічні ризики» відноситься до дисциплін, які забезпечують професійну підготовку бакалаврів за спеціальністю «Економіка підприємства».

Метою дисципліни «Економічні ризики» є набуття знань майбутніми спеціалістами в категорії активного ризику різноманітного спектру економічних проблем з використанням спеціальних економіко-математичних методів, які входять у компетенцію фахівця-економіста.

Приєднання України до Болонського процесу передбачає впровадження кредитно-модульної системи організації навчального процесу (КМСОНП), яка є українським варіантом ECTS. Програма побудована за вимогами кредитно-модульної системи організації навчального процесу.

Програма навчальної дисципліни розроблена на основі:

Освітньо-кваліфікаційна характеристика бакалавра спеціальності 6.050100 – «Економіка підприємства» (галузевий стандарт вищої освіти, 2004 р.);

Освітньо-професійна програма підготовки бакалавра, спеціаліста і магістра напрямку 0501 – «Економіка і підприємництво» (галузевий стандарт вищої освіти, 2002 р.);

Навчальний план підготовки бакалавра за спеціальністю 6.050100 – «Економіка підприємства» напрямку підготовки 0501 «Економіка та підприємництво», 2003 р.).

Програма ухвалена кафедрою економіки підприємств міського господарства, протокол № 1 від 02.09.2009 р. та Вченою радою факультету Післядипломної освіти та заочного навчання (протокол № 1 від 4 вересня 2009 р.).

# 1. ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

## 1.1. Мета, предмет та місце дисципліни

**Мета:** засвоєння теоретичних знань і набуття практичних навичок в категорії активного ризику різноманітного спектру економічних проблем.

**Завдання:** вивчення теоретичних і практичних засад економічних ризиків у діяльності підприємства; набуття навичок з використанням спеціальних економіко-математичних методів, які входять у компетенцію фахівця-економіста.

**Предмет вивчення дисципліни:**

– розширення й поглиблення знань якісних і кількісних особливостей економічних процесів з урахуванням економічних ризиків;

– оволодіння методологією і методикою побудови, аналізу та використання економіко-математичних методів, які ураховують економічні ризики;

– вивчення типових заходів моделювання та вимірювання економічного ризику в процесі прийняття управлінських рішень, оволодіння відповідним апаратом з метою практичного використання в рішенні різноманітних економічних проблем.

Таблиця 1.1 – Місце дисципліни в структурно-логічній схемі підготовки фахівця

Дисципліни, що передують вивченню даної дисципліни	Дисципліни, вивчення яких спирається на дану дисципліну
Філософія Політична економіка Макроекономіка Мікроекономіка Теорія ймовірностей Економіка підприємств Математична статистика	Інвестування Ціноутворення на підприємствах МГ Планування діяльності підприємства Стратегія управління підприємством Фінансовий менеджмент Управління потенціалом підприємства Економічна діагностика

## 1.2. Інформаційний обсяг (зміст) дисципліни

Модуль ЕКОНОМІЧНІ РИЗИКИ ..... (3,0/108)

ЗМ 1.1. Ризик у господарській діяльності підприємств в умовах ринкових відносин..... (1,5/ 54)

Неминучість ризику в господарській діяльності підприємств. Сутність і класифікація економічних ризиків. Ризики у виробничій діяльності. Фінансові ризики. Банківські ризики. Теорія корисності і прийняття рішень в умовах ризику. Методи оцінки економічних ризиків, класифікація вимірів ризику.

ЗМ 1.2. Методи оцінки і зниження економічних ризиків.....(1,5/ 54)

Система кількісних оцінок економічного ризику. Експертні оцінки виміру ризику. Ризик і теорія ігор. Ризик на фінансовому ринку. Методи зниження ризику в різних сферах діяльності виробників.

### 1.3. Освітньо-кваліфікаційні вимоги

Таблиця 1.2 – . Освітньо-кваліфікаційні вимоги до дисципліни

Вміння (за рівнями сформованості)	Сфери діяльності (виробнича, соціально-виробнича, соціально-побутова)	Функції діяльності у виробничій сфері (проектувальна, організаційна, управлінська, виконавська, технічна, інші)
<p><b>Репродуктивний рівень</b> Визначати вид ризику, який впливає на прийняття конкретного управлінського рішення; кількісно оцінювати вплив ризику за допомогою економіко-математичних методів; обирати оптимальне управлінське рішення з використанням різноманітних критеріїв теорії ігор</p>	виробнича, соціально-виробнича, соціально-побутова	виконавська
<p><b>Алгоритмічний рівень</b> Прямими та непрямими методами вирішувати задачі стохастичного програмування; використовувати методи оцінки капітальних активів і метод надійності ринку при аналізі фінансового ризику; формувати оптимальний портфель інвестицій з урахуванням міри ризику цінних паперів; розраховувати норму дисконту з урахуванням ризику при оцінці майна підприємства</p>	виробнича, соціально-виробнича, соціально-побутова	аналітична
<p><b>Евристичний рівень</b> Розробляти необхідні заходи щодо зменшення впливу конкретного ризику на діяльність підприємства</p>	виробнича, соціально-виробнича, соціально-побутова	аналітична

#### 1.4. Рекомендована основна навчальна література

Таблиця 1.3 – Рекомендована основна навчальна література для вивчення дисципліни

Бібліографічні описи, Інтернет адреси	ЗМ, де застосовується
<b>1. Основна література</b>	
1.1 Донець Л.І. Економічні ризики та методи їх вимірювання. Навч.пос. – К.: Центр уч.літ., 2006. – 320 с.	1.1, 1.2
1.2 Клебанова Т.С., Раевнева Е.В. Теория экономического риска: Учебно-методическое пособие для самостоятельного изучения дисциплины. – Х.: Издательский Дом “ИНЖЭК”, 2003. – 156 с.	1.1, 1.2
1.3 Верчено П.І., Великоіваненко Г.І., Демчук Н.В. та ін. Ризикологія: Навч.-метод. посіб. для самот. вивч. дисц. – К.: КНЕУ, 2006. – 176 с.	1.1, 1.2
1.4 Івченко І.Ю. Економічні ризики: Навчальний посібник. - К.: Центр навчальної літератури, 2004. – 304 с.	1.1, 1.2
<b>2. Додаткові джерела</b>	
2.1 Ф.Х. Найт Риск, неопределенность и прибыль / пер. с англ. – М.: Дело, 2003. – 360 с.	1.1, 1.2
2.2 Блюмин С.Л., Шуйкова И.А. Модели и методы принятия решений в условиях неопределенности. – Липецк: ЛЭГИ, 2001. – 138 с.	1.1, 1.2
2.3 Лук'янова В.В., Головач Т.В. Економічний ризик: Навч.посіб. - К.: Академвидав, 2007. – 464 с.	1.1, 1.2
2.4 Энциклопедия финансового риск-менеджмента / Под ред. А.А. Лобанова и А.В. Чугунова. – М.: Альпина Паблишер, 2003. – 786 с.	1.1, 1.2
<b>3. Методичне забезпечення</b>	
3.1 Методичні вказівки до виконання контрольної роботи з курсу «Економічні ризики». Укл.:Ю.Ю.Леонт'єва – Харків: ХНАМГ, 2006 – 11 с.	
3.2 Методичні вказівки до самостійного вивчення курсу «Економічні ризики». – Харків-ХНАМГ - 2008 Укл.: Ю.Ю.Леонт'єва, К.О.Кожокіна, 2008 – 28 с.	
3.3 Методичні вказівки до виконання практичних занять з курсу «Економічні ризики». Укл.:Ю.Ю.Леонт'єва – Харків: ХНАМГ, 2009 – 16 с.	
3.4 Светличная Т.И. Теоретические основы курса «Экономический риск и методы его измерения». Уч. пос. -Харьков: ХГАГХ, 2000.-144 с.	

## 1.5. Анотація програми навчальної дисципліни

### «Економічні ризики»

**Мета:** засвоєння теоретичних знань і набуття практичних навичок в категорії активного ризику різноманітного спектру економічних проблем.

**Завдання:** вивчення теоретичних і практичних засад економічних ризиків у діяльності підприємства; набуття навичок використання спеціальних економіко-математичних методів, які входять у компетенцію фахівця-економіста.

#### **Предмет вивчення дисципліни:**

– розширення й поглиблення знань з вивчення якісних і кількісних особливостей економічних процесів з урахуванням економічних ризиків;

– оволодіння методологією і методикою побудови, аналізу та використання економіко-математичних методів, які ураховують економічні ризики;

– вивчення типових заходів моделювання та вимірювання економічного ризику в процесі прийняття управлінських рішень, оволодіння відповідним апаратом з метою практичного використання в рішенні різноманітних економічних проблем.

### «Economic risks»

**Purpose:** *Mastering of theoretical knowledge and finding of practical skills in a category of active risk of a diverse spectrum of economic problems.*

**Task:** *Studying of theoretical and practical bases of economic risks in enterprise activity; finding of skills of application of economic-mathematical methods which are included into the competence of the expert-economist.*

#### **Article of study discipline:**

– *expansion and deepening of knowledge on studying of qualitative and*



*quantitative features of economic processes with allowance for economic risks;*

*– mastering by methodology and technique of construction, the analysis and use of the economic-mathematical methods considering economic risks;*

*– studying of typical receptions of modelling and measurement of economic risk in the course of acceptance of administrative decisions, mastering by the corresponding device for the purpose practical application in the decision of diverse economic problems.*

### **«Экономические риски»**

**Цель:** усвоение теоретических знаний и обретение практических навыков в категории активного риска разнообразного спектра экономических проблем.

**Задача:** изучение теоретических и практических основ экономических рисков в деятельности предприятия; обретение навыков применения экономико-математических методов, которые входят в компетенцию специалиста-экономиста.

#### **Предмет изучения дисциплины:**

– расширение и углубление знаний по изучению качественных и количественных особенностей экономических процессов с учетом экономических рисков;

– овладение методологией и методикой построения, анализа и использования экономико-математических методов, учитывающих экономические риски;

– изучение типичных приемов моделирования и измерения экономического риска в процессе принятия управленческих решений, овладение соответствующим аппаратом с целью практического применения в решении разнообразных экономических проблем.

## 2. РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

### 2.1. Структура навчальної дисципліни

Таблиця 2.1 – Структура навчальної дисципліни для заочної форми навчання

Призначення: підготовка спеціалістів	Напрямок, спеціальність, освітньо-кваліфікаційний рівень	Характеристика навчальної дисципліни
<b>Кількість кредитів,</b> відповідних ECTS – 3,0 <b>Модулів – 1, КР</b> <b>Змістових модулів –</b> 2 <b>Загальна кількість</b> <b>годин –108,0 КР</b>	<b>Напрямок 0501</b> «Економіка і підприємництво» <b>Спеціальності:</b> 6.050100 – «Економіка підприємства» <b>Освітньо-кваліфікаційний</b> <b>рівень:</b> Бакалавр	<b>Нормативна</b> <b>Рік підготовки:</b> 3-й <b>Семестр:</b> 6-й <b>Лекції – 6 год.</b> <b>Практичні – 4 год.</b> <b>Самостійна робота – 98</b> год. із них КР – 10 год <b>Вид підсумкового</b> <b>контролю – залік</b>

*Примітка:* співвідношення кількості годин аудиторних занять і самостійної роботи становить 10% до 90%.

У процесі навчання студенти отримують необхідні знання під час проведення аудиторних занять: лекційних, практичних. Найбільш складні питання винесено на розгляд і обговорення під час практичних занять. Також велике значення в процесі вивчення і закріплення знань має самостійна робота студентів. Усі ці види занять розроблені відповідно до положень Болонської декларації.

### 2.2. Тематичний план навчальної дисципліни

Тематичний план дисципліни «Економічні ризики» складається з двох змістових модулів, кожен з яких поєднує в собі відносно окремий самостійний блок дисципліни, який логічно пов'язує кілька навчальних елементів дисципліни за змістом і взаємозв'язками.

Навчальний процес здійснюється в таких формах: лекційні, практичні заняття, самостійна робота студента.

Зміст дисципліни розкривається в темах:

#### **Тема 1. Неминучість ризику в господарській діяльності підприємств**

Об'єктивність постановки проблеми економічного ризику, його суть. Поняття «визначеність», «ризик», «невизначеність», їх якісні відмінності. Прийняття управлінських рішень в умовах визначеності, ризику й невизначеності. Ситуації, пов'язані з ризиком. Вплив обсягу одержуваної релевантної інформації на величину ризику й очікуваного доходу.

Поняття «економічний ризик», «об'єкт» і «суб'єкт» ризику. Об'єктивні й

суб'єктивні джерела виникнення ризику. Аналіз ситуацій виникнення ризиків. Причини виникнення максимального ризику.

Політика управління ризиком, її роль у цілеспрямованому розвитку підприємства (фірми). Визначення стратегії ризику, його границь (діапазонів), оцінка ризику - основні напрямки політики управління ризиком.

Принципи управління ризиком.

**Тема 2. Сутність і класифікація економічних ризиків. (Ризики у виробничій діяльності. Фінансові ризики. Банківські ризики)**

Класифікація ризиків за: рівнем економічного управління; тривалості впливу ризику; сфері діяльності виробника; характеру прояву; систематичності впливу.

Аналіз спектра ризиків, що впливають на діяльність виробників. Зовнішні й внутрішні ризики виробників. Категорії страхового, валютного й ризику форсмажорних обставин.

Внутрішні економічні ризики як відбиття діяльності господарюючих суб'єктів. Поняття систематичних ризиків: ризик інфляції, зміни процентних ставок, падіння загальноринкових. Сутність несистематичних ризиків; галузевий і фінансовий ризики.

Історія виникнення теорій ризику. Основоположник теорій ризику - Г. Маркович і його теорія ефективного портфеля.

**Тема 3. Теорія корисності і 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. Концепція корисності фон Неймана - Моргенштерна, основні аксіоми. Поводження суб'єкта господарювання залежно від його схильності до ризику. Побудова функції корисності ОПР на основі його відносини до ризику. Максимізація очікуваної корисності.

Аналіз ризику за допомогою функції корисності. Локальна й глобальна відмова від ризику. Відмова від ризику за розміром його наслідків.

«Портфельний» підхід до теорії грошей. Можливості й мети переваги інвестора. Формування співвідношень між кількістю грошей і цінних паперів, між ризиком і рівнем доходу.

**Тема 4. Методи оцінки економічних ризиків, класифікація вимірів ризику**

Розмаїтість методів виміру ризику. Класифікація методів: загальні й спеціальні; кількісні і якісні.

Загальні методи виміру економічного ризику.

Статистичний метод. Крива Лоренца й спосіб її побудови. Оцінка ризику за допомогою формули проф. Маслова. Класифікація областей ризику.

Метод аналізу доцільності витрат. Поняття й формування областей ризику. Показники забезпеченості запасів і витрат джерелами їх формування.

Аналітичний метод виміру ризику. Зменшення ризику за рахунок вивчення механізму формування прибутку. Аналіз чутливості моделі. Аналіз величини відносних ризиків.

Метод аналогій. Використання баз даних при визначенні ризику аналогічних проектів. Вивчення життєвого циклу проектів. Диверсифікованість ризику по стадіях життєвого циклу.

### **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 й ризик часу.

Відносні оцінки ризику: премія за ризик, мінливість очікуваних результатів.

Імовірність настання події – основа кількісної оцінки ризику. Об'єктивна й суб'єктивна ймовірності. 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. Експертні оцінки виміру ризику**

Характеристика експертних процедур. Загальна схема експертизи. Підготовка експертизи.

Методи обробки експертної інформації: статистичні методи, алгебраїчні методи тощо. Оцінка погодженості думок експертів. Коефіцієнт конкордації.

Аналіз рівня странового ризику: індекс БЕРІ.

### **Тема 7. Ризик і теорія ігор**

Основні поняття ігор. Ціль гри. Класифікації ігор. Рівноважна стратегія й ризикова стратегія. Ризик в іграх природи й в іграх проти гравця.

Критерії прийняття оптимальних рішень: Лапласа, Вальда, Гурвіца, Севіджа, Байеса, Ходжеса-Лемана.

Вибір оптимальної стратегії розвитку фірми в умовах ризику й невизначеності.

### **Тема 8. Ризик на фінансовому ринку**

Сучасна фінансова теорія й ринок капітальних активів. Співвідношення ризику й доходу. Оцінка віддачі від вкладених коштів.

Розрахунок очікуваних доходів в умовах ризику й невизначеності. Коефіцієнт варіації як критерій вкладення грошей в інвестиційний проект.

Статистична модель вибору портфеля інвестора. Ризик портфеля. Ефект диверсифікованості портфеля. Коваріація й мінливість.

Визначення ризику й віддачі за допомогою моделі оцінки капітальних активів (МОКА). Міра чутливості цінних паперів до ринку. Визначення необхідної норми прибутковості проекту.

Визначення ризику з використанням ліній надійності ринку. Ринок і загальна рівновага.

Методи визначення доцільності інвестицій з урахуванням ризику: метод еквівалента впевненості; аналіз чутливості реагування.

## Тема 9. Методи зниження ризику в різних сферах діяльності виробників

Способи й принципи зниження ризику: запобігання ризику, утримання ризику, передача й зниження ступеня ризику.

Методи зниження ризику на сучасному фінансовому ринку. Фінансові ф'ючерси й опціони. Хеджування контрактів і опціонів.

Управління валютними ризиками. Методи зниження валютного ризику.

Методи зниження банківського ризику.

Страхування операцій із цінними паперами.

### 2.3. Розподіл часу за модулями і змістовими модулями та форми навчальної роботи студента

Таблиця 2.2 – Розподіл часу за модулями і змістовими модулями (заочне навчання)

Модулі (семестри) та змістові модулі	Всього, кредит / годин	Форми навчальної роботи			
		Лекц.	Сем., пр.	Лаб.	СРС
Модуль	3,0/108	6	4	–	98
ЗМ1.1.	1,5/ 54	3	2	–	49
ЗМ1.2.	1,5/ 54	3	2	–	49

Таблиця 2.3 – Лекційний курс (заочне навчання)

Зміст	Кількість годин за спеціальностями, спеціалізаціями (шифр, аббревіатура) 6.050100 ЕП
<b><u>ЗМ 1. Ризик у господарській діяльності підприємств в умовах ринкових відносин</u></b>	<b>3,0</b>
1. Неминучість ризику в господарській діяльності підприємств	1,0
2. Сутність і класифікація економічних ризиків. (Ризики у виробничій діяльності. Фінансові ризики. Банківські ризики)	–
3. Теорія корисності і прийняття рішень в умовах ризику	1,0
4. Методи оцінки економічних ризиків, класифікація вимірів ризику	1,0
<b><u>ЗМ 2. Методи оцінки і зниження економічних ризиків</u></b>	<b>3,0</b>
5. Система кількісних оцінок економічного ризику	1,0
6. Експертні оцінки виміру ризику	1,0
7. Ризик і теорія ігор	–
8. Ризик на фінансовому ринку	–
9. Методи зниження ризику в різних сферах діяльності виробників	1,0
<b>РАЗОМ</b>	<b>6,0</b>

Таблиця 2.4 – Практичні заняття (заочне навчання)

Зміст	Кількість годин за спеціальностями, спеціалізація ми (шифр, аббревіатура) 6.050100 ЕП
1	2
<b><u>ЗМ 1. Ризик у господарській діяльності підприємств в умовах ринкових відносин</u></b>	<b>2,0</b>
1. Неминучість ризику в господарській діяльності підприємств	–
2. Сутність і класифікація економічних ризиків. (Ризики у виробничій діяльності. Фінансові ризики. Банківські ризики)	1,0
3. Теорія корисності і прийняття рішень в умовах ризику	1,0
4. Методи оцінки економічних ризиків, класифікація вимірів ризику	–
<b><u>ЗМ 2. Методи оцінки і зниження економічних ризиків</u></b>	<b>2,0</b>
5. Система кількісних оцінок економічного ризику	–
6. Експертні оцінки виміру ризику	1,0
7. Ризик і теорія ігор	1,0
8. Ризик на фінансовому ринку	–
9. Методи зниження ризику в різних сферах діяльності виробників	–
<b>РАЗОМ</b>	<b>4,0</b>

#### 2.4. Розподіл часу самостійної навчальної роботи студента

Самостійна навчальна робота розрахована на формування практичних навичок у роботі студентів зі спеціальною літературою, орієнтування їх на інтенсивну роботу, критичне осмислення здобутих знань і глибоке вивчення теоретичних і практичних проблем ефективного функціонування підприємства та його структурних підрозділів.

Таблиця 2.5 – Самостійна навчальна робота студента

Форми самостійної роботи (за змістовими модулями)	Години ЕП	Форма звіту
1	2	3
<b>ЗМ 1.1. <u>Ризик у господарській діяльності підприємств в умовах ринкових відносин</u></b>	<b>49</b>	
1.Огляд основної та додаткової літератури	12	Конспект
2. <b>Т.1. Неминучість ризику в господарській діяльності підприємств:</b> - ведення термінологічного словника - розгляд контрольних запитань - тестові завдання	8	Відповіді у зошиті для самостійних робот
3. <b>Т.2. Сутність і класифікація економічних ризиків. (Ризики у виробничій діяльності. Фінансові ризики. Банківські ризики):</b> - ведення термінологічного словника - розгляд контрольних запитань - тестові завдання	8	Відповіді у зошиті для самостійних робот
4. <b>Т.3. Теорія корисності і прийняття рішень в умовах ризику:</b> - ведення термінологічного словника - розгляд контрольних запитань - тестові завдання - вирішення завдань	8	Відповіді у зошиті для самостійних робот
5. <b>Т.4. Методи оцінки економічних ризиків, класифікація вимірів ризику:</b> - ведення термінологічного словника - розгляд контрольних запитань - тестові завдання	8	Відповіді у зошиті для самостійних робот
6. Виконання контрольної роботи	5	
<b>ЗМ 1.2. <u>Методи оцінки і зниження економічних ризиків</u></b>	<b>49</b>	
1.Огляд основної та додаткової літератури	9	Конспект
2. <b>Т.5. Система кількісних оцінок економічного ризику:</b> - ведення термінологічного словника - розгляд контрольних запитань - тестові завдання - вирішення завдань	7	Відповіді у зошиті для самостійних робот

1	2	3
3. <b>Т.6. Експертні оцінки виміру ризику:</b> - ведення термінологічного словника - розгляд контрольних запитань - тестові завдання	7	Відповіді у зошиті для самостійних робіт
4. <b>Т.7. Ризик і теорія ігор:</b> - ведення термінологічного словника - розгляд контрольних запитань - тестові завдання - вирішення завдань	7	Відповіді у зошиті для самостійних робіт
5. <b>Т.8. Ризик на фінансовому ринку:</b> - ведення термінологічного словника - розгляд контрольних запитань - тестові завдання	7	Відповіді у зошиті для самостійних робіт
6. <b>Т.9. Методи зниження ризику в різних сферах діяльності виробників:</b> - ведення термінологічного словника - розгляд контрольних запитань - тестові завдання - вирішення завдань	7	Відповіді у зошиті для самостійних робіт
7. Виконання контрольної роботи	5	Оформлення у відповідному порядку згідно з вимогами КР
<b>РАЗОМ:</b>	<b>98</b>	

## 2.5. Засоби контролю та структура залікового кредиту

Таблиця 2.6 – Засоби контролю та структура залікового кредиту дисципліни

<i>Види та засоби контролю (тестування, контрольні роботи, індивідуальні завдання тощо)</i>
<b>МОДУЛЬ 1. Поточний контроль зі змістових модулів</b>
Вибіркове опитування на практичних заняттях
Контрольна робота
<b>Підсумковий контроль за МОДУЛЕМ 1</b>
Залік (проводиться у вигляді письмового контролю)



## 2.6. Методи та критерії оцінювання знань

Для визначення рівня засвоєння студентами навчального матеріалу використовують такі форми та методи контролю і оцінювання знань:

- поточний контроль зі змістових модулів;
- складання заліку.

Порядок здійснення поточного оцінювання знань студентів.

Поточний модульний контроль рівня знань передбачає виявлення опанування студентом матеріалу лекційного модуля та вміння застосувати його для вирішення практичної ситуації і проводиться у вигляді письмового контролю (контрольна робота).

Поточний контроль проводиться у письмовій формі після того як розглянуто увесь теоретичний матеріал та проведені практичні завдання в межах кожного з ЗМ.

Проведення підсумкового контролю.

Підсумком вивчення дисципліни для студентів є складання заліку, який оцінюється за двобальною шкалою: «залік» або «незалік».

«Залік» виставляють студенту, який виявив повне знання з поставлених питань, вільно володіє матеріалом, логічно й ґрунтовно відповідає на поставлені запитання, вміє застосувати отримані знання для аналізу й розробки практичної діяльності підприємства, або виявив повне знання з поставлених питань, але припускає логічну непослідовність або не може застосувати отримані знання при практичному розв'язанні завдань. При цьому студент вміє виправити неточності відповіді після зауваження викладача.

«Незалік» виставляють, якщо студент не володіє знанням суттєвих елементів навчального матеріалу, припускається грубих помилок.

В окремих випадках викладач при тестовій формі оцінки знань або при оцінці контрольної роботи може запропонувати студенту обґрунтувати свої відповіді.

## 2.7. Інформаційно-методичне забезпечення

Таблиця 2.7 – Рекомендована основна навчальна література для вивчення дисципліни

Бібліографічні описи, Інтернет адреси		ЗМ, де застосовується
<b>1. Основна література</b>		
1.1	Донець Л.І. Економічні ризики та методи їх вимірювання. Навч.пос. – К.: Центр уч.літ., 2006. – 320 с.	1.1, 1.2
1.2	Клебанова Т.С., Раевна Е.В. Теория экономического риска: Учебно-методическое пособие для самостоятельного изучения дисциплины. – Х.: Издательский Дом “ИНЖЭК”, 2003. – 156 с.	1.1, 1.2
1.3	Верчено П.І., Великоіваненко Г.І., Демчук Н.В. та ін. Ризикологія: Навч.-метод. посіб. для самост. вивч. дисц. – К.: КНЕУ, 2006. – 176 с.	1.1, 1.2
1.4	Івченко І.Ю. Економічні ризики: Навчальний посібник. - К.: Центр навчальної літератури, 2004. – 304 с.	1.1, 1.2
1.5	Балабанов И.Т. Риск-менеджмент. М.: Финансы и статистика, 1996.-348 с.	1.1, 1.2
<b>2. Додаткові джерела</b>		
2.1	Ф.Х. Найт Риск, неопределенность и прибыль / пер. с англ. – М.: Дело, 2003. – 360 с.	1.1, 1.2
2.2	Блюмин С.Л., Шуйкова И.А. Модели и методы принятия решений в условиях неопределенности. – Липецк: ЛЭГИ, 2001. – 138 с.	1.1, 1.2
2.3	Лук'янова В.В., Головач Т.В. Економічний ризик: Навч.посіб. - К.: Академвидав, 2007. – 464 с.	1.1, 1.2
2.4	Энциклопедия финансового риск-менеджмента / Под ред. А.А. Лобанова и А.В. Чугунова. – М.: Альпина Паблишер, 2003. – 786 с.	1.1, 1.2
2.5	Тони Раис, Браин Коили. Финансовые инвестиции и риск. Пер. с англ. - К.: Торгово-издательское бюро ВНУ, 1995.- 590 с.	1.1, 1.2
<b>3. Методичне забезпечення</b>		
3.1	Методичні вказівки до виконання контрольної роботи з курсу «Економічні ризики». Укл.:Ю.Ю.Леонт'єва – Харків: ХНАМГ, 2006 – 11 с.	
3.2	Методичні вказівки до самостійного вивчення курсу «Економічні ризики». – Харків-ХНАМГ - 2008 Укл.: Ю.Ю.Леонт'єва, К.О.Кожокіна, 2008 – 28 с.	
3.3	Методичні вказівки до виконання практичних занять з курсу «Економічні ризики». Укл.:Ю.Ю.Леонт'єва – Харків: ХНАМГ, 2009 – 16 с.	
3.4	Светличная Т.И. Теоретические основы курса «Экономический риск и методы его измерения». Уч. пос. -Харьков: ХГАГХ, 2000.-144 с.	

## НАВЧАЛЬНЕ ВИДАННЯ

Програма і робоча програма навчальної дисципліни

«Економічні ризики»

для студентів 3 курсу заочної форми навчання освітньо-кваліфікаційного рівня  
бакалавр, напряму підготовки 0501 – «Економіка і підприємництво», 6.030504

«Економіка підприємства»

Укладачі: Юлія Юріївна Леонт'єва

Тетяна Іванівна Світлична

План 2009, поз. 812 Р

Підп. до друку 09.11.2009	Формат 60×84 1/16	Папір офісний
Друк на ризографі.	Умовн.-друк. арк. 1,0	Обл.-вид. арк. 1,3
Замовл № 5417	Тираж 10 прим.	

61002, Харків, ХНАМГ, вул. Революції, 12

Сектор оперативної поліграфії ЦНІТ ХНАМГ

61002, Харків, ХНАМГ, вул. Революції, 12