

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ, МОЛОДІ ТА СПОРТУ УКРАЇНИ  
ХАРЬКІВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ ЕКОНОМІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ

Робоча програма навчальної дисципліни  
«Методи діагностики та прогнозування розвитку підприємства»  
для студентів напряму підготовки «Менеджмент»  
денної форми навчання

Викладач Омелаєнко Ніна Миколаївна;  
Тонева Кристина Валеріївна;  
Пономаренко Олена Едуардівна

Відповідальний за випуск Ястремська О.М.

Харків. Вид. ХНЕУ, 2012

Затверджено на засіданні кафедри економіки, організації та планування діяльності підприємства.

Протокол № 1 від 25. 08. 2011.

Р 78 Робоча програма навчальної дисципліни «Методи діагностики та прогнозування розвитку підприємства» для студентів напряму підготовки «Менеджмент» денної форми навчання / Укл. Омелаєнко Н.М., Тонева К.В., Пономаренко О.Е. – Харків: Вид ХНЕУ, 2012. – 41 с. (Укр. мов.)

Має тематичний план навчальної дисципліни та її зміст за модулем й темами, також плани лекцій та лабораторних занять, методичні рекомендації, питання для закріплення знань та система оцінювання знань студентів.

Рекомендовано для студентів економічних спеціальностей.

## Вступ

В сучасних умовах функціонування підприємств важливим для їх сталого розвитку є створення об'єктивної системи діагностики діяльності підприємств, яка виступає основою для прийняття управлінських рішень на різних рівнях менеджменту підприємств.

Діагностика підприємства виступає системою теоретичних та практичних знань щодо аналізу результатів функціонування підприємства, виявлення сильних та слабких сторін його економічної діяльності, та виявлення напрямлень щодо поліпшення визначених результатів.

Ефективність вирішення соціально-економічних завдань залежить від вибору стратегії на довгострокову перспективу. У зв'язку з цим зростає роль перспективного планування та обґрунтованих прогнозів.

Прогнозування визначає основні напрямки розвитку, а план – розробку основних способів досягнення поставленої мети. У зв'язку з цим майбутні менеджери повинні знати та вміти будувати різні моделі прогнозування.

Навчальна дисципліна «Методи діагностики та прогнозування розвитку підприємства» належить до циклу дисциплін по вибору для студентів напряму підготовки 0502 «Менеджмент».

Мета дисципліни – формування необхідних теоретичних знань та практичних навичок щодо: встановлення характеру порушень нормального ходу економічних процесів на підставі типових ознак, що характерні для конкретного порушення, а також використання різних методів та моделей прогнозування, що забезпечують оптимізацію задач розвитку підприємства.

Завдання дисципліни - засвоїти теоретичний курс та закріпити його на лабораторних заняттях, виробити навички: діагностики для забезпечення ефективного управління підприємством; побудови та розв'язання прогнозних моделей розвитку підприємства за допомогою ПЕОМ та спеціалізованих прикладних програмних пакетів.

Предмет дисципліни – економіко-математичні, статистичні та логічні методи аналізу процесу функціонування підприємства, а також економіко-математичні методи та засоби прогнозування економічних процесів.

«Методи діагностики та прогнозування розвитку підприємства» викладається після вивчення студентами дисциплін блоку «Бухгалтерський облік», «Вища математика», «Дослідження операцій», «Економетрика», «Економіка підприємства», «Теорія економічного аналізу», «Маркетинг», «Мікроекономіка», «Основи менеджменту», «Планування на підприємстві», «Політична економія», «Стратегічний менеджмент», «Фінансовий аналіз». Ця дисципліна пов'язує дисципліни математичного циклу з економічними науками, що потребує вивчення професійно орієнтованих дисциплін, а також становить основу для проведення економічних досліджень.

Основу навчальної дисципліни складають лекції, лабораторні заняття, самостійна та індивідуальна робота. Дисципліна «Методи діагностики та прогнозування розвитку підприємства» вивчається студентами на 4 курс. Після закінчення студенті складають залік.

Структура програми дисципліни «Методи діагностики та прогнозування розвитку підприємства» дана у табл. 1.

Таблиця 1

**Структура програми «Методи діагностики та прогнозування розвитку підприємства»**

Начальна дисципліна: підготовка бакалаврів	Галузь знань, напрям підготовки, освітньо-кваліфікаційний рівень	Характеристика навчальної дисципліни
Кількість кредитів, відповідних ECTS – 4,5; у тому числі: змістових модулів -2; самостійна робота;	Шифр та назва галузі знань: 0306 «Менеджмент і адміністрування»	По вибору. Рік підготовки: 4. Семестр: 7
Кількість годин: усього – 162; за змістовими модулями: модуль 1 – 80 година; модуль 2 – 82 годин	Назва напрямку підготовки; спеціалізацій: «Менеджмент»; усі спеціалізації цього напрямку підготовки	Лекції – 34 годин. Лабораторні заняття - 34 години. Самостійна робота – 94 години

Кількість тижнів викладення навчальної дисципліни: 17. Кількість годин за тиждень – 4	Освітньо- кваліфікаційний рівень – бакалавр	Від контролю: залік
---------------------------------------------------------------------------------------------------	---------------------------------------------------	---------------------

## 1. Кваліфікаційні вимоги до студентів

Вивчення навчальної дисципліни «Методи діагностики та прогнозування розвитку підприємства» базується на знаннях, які були одержані студентами під час вивчення дисциплін економічного та математичного циклів: «Вища математика», «Дослідження операцій», «Економетрика», «Теорія економічного аналізу», «Маркетинг», «Мікроекономіка», «Основи менеджменту», «Політична економія», «Статистика», «Стратегічне планування», «Фінансовий аналіз» та інші.

Загальні знання та навички, що дає студентам дисципліна «Методи діагностики та прогнозування розвитку підприємства», можуть бути розширені в процесі вивчення дисциплін за спеціальністю. Отримані знання студенти використовують при виконанні курсових, дипломних робіт, а також у наукових дослідженнях.

У процесі навчання студенти отримують необхідні знання під час лекційних занять, при виконанні лабораторних завдань. Велике значення в процесі вивчання та закріплення знань має самостійна робота студентів. Усі види занять розроблені відповідно положенням Булонської декларації.

Після вивчення навчальної дисципліни студент повинен

### **знати:**

сутність категорії діагностики підприємства, методи її проведення, принципи та інструментарій діагностики результатів діяльності та стану підприємства;

інструментарій оцінки конкурентного середовища підприємства, його конкурентоспроможності та конкурентоспроможності його продукції;

методичні засади оцінки вартості підприємства та оцінки економічної безпеки підприємства, вміти її проводити;

що таке прогноз та прогнозування;

види прогнозів;

з чого складається процес прогнозування;  
особливості прогнозування;  
основні поняття в галузі прогнозування;  
взаємозв'язок прогнозу та плану;  
етапи прогнозування;  
джерела та види інформації при прогнозуванні;  
основні класифікаційні ознаки моделей прогнозування;  
методи обробки часових рядов;  
етапи побудови трендової моделі;  
показники точності прогнозів;  
прогнозування за допомогою змінної середньої;  
як будується авторегресивна модель;  
що таке автокореляція та якими показниками можна її оцінити;  
що таке лаг;  
що таке експертні методи прогнозування;  
як відбирати експертів;  
особливості методу «Дельфі» та його використання у прогнозуванні розвитку підприємства;  
особливості методу «мозкового штурму» та його використання у розробки альтернатив розвитку підприємства;  
особливості методів сценарію та прогнозних графів у розробки стратегії виробництва;

**вміти:**

формуванню методик проведення комплексної економічної діагностики підприємства, що здатна виявляти можливості та загрози з боку зовнішнього та внутрішнього середовища;  
визначати масштаби конкурентного середовища підприємства, аналізувати та прогнозувати вплив факторів конкуренції, оцінювати становище конкурентів;  
оцінювати доцільність залучення ресурсів у виробництво, перевіряти дотримання параметрів їх використання;  
визначати та розраховувати аналітичні показники, що характеризують ефективність використання ресурсів підприємства та результати його діяльності;  
розробляти техніко-економічне обґрунтування вдосконалення процесів життєдіяльності підприємства, покращення стану підприємства.  
здійснювати аналіз об'єктів прогнозування;

вибирати теоретичний апарат оцінки тенденцій розвитку;  
виконувати аналіз часових рядов;  
вибирати та оцінювати інформацію, що необхідна для побудови прогнозної моделі;  
планувати основні етапи побудови прогнозної моделі;  
оцінювати точність прогнозної моделі;  
здійснити прогнозування на основі змінної середньої;  
будувати трендові моделі прогнозування;  
будувати регресивні моделі прогнозування;  
оцінювати лаг;  
давати оцінку можливих помилок експертів;  
оцінювати автокореляцію у часовому ряду;  
будувати авторегресивні моделі прогнозування;  
використовувати прикладні програми при розробки різних моделей прогнозування на ПЕОМ.

Компетенції, якими мають володіти випускники, після вивчення дисципліни, це:

**здатність:**

до вибору методології, розробки та опрацювання аналізу діяльності підприємства;

застосовувати методичний апарат та інструментарій економічного діагностування для оцінки конкурентного середовища підприємства;

до прогнозування фінансово-економічної діяльності підприємства та формування рекомендацій щодо її оптимізації;

до обліку та контролю за ефективністю виконання роботи з діагностики діяльності підприємства;

до здійснення аналізу стану та фінансово-економічної діяльності підприємства;

до формування інформаційної бази аналізу діяльності підприємства;

до впровадження рішень щодо підвищення ефективності діяльності підприємства;

до обґрунтування, побудови, рішення та використання у економіці, організації та плануванні виробничої діяльності, при розробки

економічних стратегій розвитку підприємства різних моделей та методів прогнозування;

до роботи у команді, сприяти згуртованості колективу;

до консультування особи, що приймає рішення, в сфері підвищення ефективності діяльності підприємства;

до швидкої адаптації до умов зовнішнього середовища, що змінюються, та ефективного оцінювання визначених змін;

до самостійного освоєння нових методів та методологій здійснення оцінки стану та діяльності підприємства;

знання методичних основ аналізу економічного стану та діагностики діяльності підприємства;

вміння застосовувати набуті знання у практичній діяльності;

лідерство та прийняття рішень щодо оптимізації діяльності підприємства.

## **2. Тематичний план навчальної дисципліни**

Перед вивченням даної дисципліни студент повинен ознайомитись з програмою дисципліни, формами організації навчального процесу, з темами лекційних, лабораторних та самостійних робіт, обсягом та структурою навчальних модулів, видами контролю та методикою оцінювання навчальної роботи.

Навчальний процес згідно з програмою дисципліни «Методи діагностики та прогнозування розвитку підприємства» здійснюється в таких формах: лекційні заняття, лабораторні роботи, самостійна робота, контрольні заходи.

Дисципліна «Методи діагностики та прогнозування розвитку підприємства» має 2 навчальних модуля:

змістовний модуль 1. Діагностика роботи підприємства;

змістовий модуль 2. Прогнозування розвитку підприємства.



## Структура залікового кредиту навчальної дисципліни

Тема	Кількість годин, відведених на:		
	лекції	лабораторні завдання	самостійну роботу
<b>Змістовний модуль 1. Діагностика роботи підприємства</b>			
1. Сутність економічної діагностики підприємства	1	-	4
2. Діагностика конкурентних позицій підприємства	3	6	6
3. Діагностика потенціалу підприємства та оцінка його стану	3	4	8
4. Діагностика майна, ринкова ціна підприємства	2	2	8
5. Фінансова діагностика	2	2	6
6. Діагностика економічної безпеки підприємства	3	4	8
7. Діагностика економічної культури підприємства	2	-	6
Усього за модулем 1	16	18	46
<b>Змістовний модуль 2. Прогнозування розвитку підприємства</b>			
1. Сутність, основні поняття, метод та методика прогнозування	1	-	3
2. Моделювання об'єктів прогнозування	1	-	4
3. Аналіз часових рядів. Оцінка точності прогнозу	2	-	4
4. Трендові моделі			

прогнозування	4	8	8
5. Прогнозування за допомогою змінної середньої	2	-	4
6. Авторегресивні моделі прогнозування	2	4	4
7. Статистичні моделі прогнозування	2	-	10
8. Експертні методи прогнозування	4	4	10
Усього за модулем 2	18	16	48
Усього за модулями	34	34	94

### **3. Зміст навчальної дисципліни за модулями та темами**

#### **Змістовий модуль 1. Діагностика роботи підприємства**

##### **Тема 1. Сутність економічної діагностики підприємства**

Підприємство (виробничо-економічна система) як об'єкт діагностики. Діагностика як спосіб розпізнавання стану виробничо - економічної системи за допомогою реалізації комплексу дослідницьких процедур і виявлення в них слабких ланок і «вузьких місць». Взаємозв'язок економічної діагностики з іншими функціями управління.

Класифікація типів і видів економічної діагностики за різними ознаками, їх характеристика.

Порядок проведення діагностичного дослідження (за етапами). Методи: кількісної оцінки (порівняння, зіставлення та ін.); економіко-математичні, якісної оцінки (експертні, причинно-наслідкові), спеціальні (моніторинг, SWOT - аналіз, бенчмаркінг та ін.) і засоби діагностики (дерева цілей, робіт, проблем, змішане).

## Тема 2. Діагностика конкурентних позицій підприємства

Умови формування конкурентного середовища підприємства, що формуються державою, конкурентами на ринку та кожним учасником ринку в процесі його ділової активності. Становище учасників ринку під впливом змін у конкурентному середовищі. Форми організації та проведення діагностики конкурентного середовища (аналітична, експертна, діагностика на моделі). Групування конкурентів за ознаками: подібні за всіма аспектами виробничо-збутової діяльності; подібні за загальними напрямками виробничо-збутової діяльності; що задовольняють ті ж потреби різними засобами; абсолютно інші, які конкурують за залучення коштів споживачів. Концепції встановлення пріоритетних конкурентів. Стратегічні групи конкурентів. Ознаки та підходи до їх формування. Принципи побудови карти стратегічних груп. Оцінка становища стратегічних груп відносно конкурентних сил на ринку. Стратегічні можливості, що має підприємство у своїй галузі. Визначення динаміки стратегічних груп.

Складові конкурентоспроможності підприємства. Фактори конкурентоспроможності підприємства. Підходи до забезпечення конкурентоспроможності підприємств. Ключові характеристики та критерії конкурентоспроможності підприємства. Підходи до оцінки конкурентоспроможності підприємства: теорія ефективної конкуренції, оцінка конкурентоспроможності товару, метод конкурентних переваг.

Складові оцінки та параметри конкурентоспроможності продукції. (корисність, ціна споживання, якість та ін.). Фактори, що мають вплив на рівень конкурентоспроможності продукції підприємства. Методичні підходи до оцінки конкурентоспроможності продукції. Процедура оцінки конкурентоспроможності продукції за інтегральним показником та з використанням матриці «ціна - якість».

## Тема 3. Діагностика потенціалу підприємства та оцінка його стану

Економічний потенціал. Ресурси підприємства. Класифікація економічного потенціалу. Складові економічного потенціалу.

Патаметри оцінки потенціалу. Діагностика виробничого, кадрового потенціалу. Методи оцінки потенціалу.

#### Тема 4. Діагностика майна, ринкова ціна підприємства

Трудова, ресурсно- витратна та природа корисної вартості господарюючого суб'єкта. Принципи формування та визнання вартості. Цільова, контрольна та стимулююча функції оцінки вартості. Види експертного оцінювання вартості майна підприємства. Характеристика видів вартості. Етапи процесу оцінки. Складові ринкової ціни підприємства. Принципи формування ринкової вартості.

Методи оцінки вартості, засновані на майновому підході (чистих активів, ліквідаційної вартості активів). Методи оцінки вартості, що базуються на дохідному підході (капіталізація чистого прибутку, капіталізація дивідендів, дисконтування грошових потоків). Методи оцінки вартості, засновані на порівняльному підході (порівняльний продаж, аналоги, галузеві коефіцієнти). Етапи та процедури оцінки вартості з використанням різних методів.

Коригування вартості підприємства на: фінансовий стан; ступінь контролю частки, що оцінюється; ліквідність частки, що оцінюється; залежно від асортименту виготовленої продукції; з урахуванням інших факторів.

#### Тема 5. Фінансова діагностика

Джерела інформації для діагностики фінансового стану підприємства. Суб'єкти аналізу (групи користувачів, які безпосередньо чи опосередковано зацікавлені в фінансовій інформації про підприємство). Принципи проведення фінансової діагностики. Етапи фінансової діагностики. Особливості складання аналітичної записки за результатами діагностики.

Баланс підприємства та звіт про фінансові результати - інформаційна база для проведення фінансової діагностики.

Діагностика підприємства за допомогою фінансових коефіцієнтів. Показники операційної діяльності (операційного аналізу та операційних витрат). Показники ефективності використання активів. Показники ліквідності. Показники структури капіталу. Показники прибутковості активів і власного капіталу. Ринкові показники.

## Тема 6. Діагностика економічної безпеки підприємства

Характеристика економічної безпеки підприємства. Поняття економічної безпеки. Джерела небезпеки та загроз і їх оцінка. Зони ризику та вразливі місця підприємства. Ознаки кризових ситуацій. Функціональні складові економічної безпеки: фінансова, техніко-технологічна, політико-правова, інформаційна, кадрова, силова, ринкова, інтерфейсна, екологічна.

Інструментарій оцінки рівня економічної безпеки підприємства. Визначення рівня економічної безпеки підприємства за функціональними складовими. Процедури розрахунку за окремими складовими. Оцінка впливу складових на зміну рівня та аналіз заходів, спрямованих на досягнення необхідного рівня економічної безпеки підприємства.

Система моніторингу стану та динаміки розвитку підприємства. Зміст та послідовність здійснення моніторингу. Організація і функціонування служби економічної безпеки підприємства та оцінка ефективності її діяльності.

## Тема 7. Діагностика економічної культури підприємства

Рівні культури: артефакти, проголошені цінності, базові уявлення. Елементи культури виробництва (за А. Погорадзе). Структура елементів корпоративної культури. Три аспекти прояву організаційної культури: моделі виконання робіт, моделі ділової взаємодії, моделі міжособистісного спілкування. Складові організаційної культури.

Модель Г. Харисона. Модель Я. Хармса. Модель Г. Хофстеда. Рамкова конструкція конкуруючих цінностей, запропонована К. Камероном та Р. Квіном. Ієрархічна, ринкова, кланова, адхократична культура.

Інструмент OSAI оцінки організаційної культури за шістьма ключовими вимірами. Побудова профілю організаційної культури.

## **Змістовний модуль 2. Прогнозування розвитку підприємства**

### **Тема 1. Сутність, основні поняття, метод та методика прогнозування**

Суть прогнозу та його роль у розвитку підприємства. Метод прогнозування. Прогнозування економічного зростання, розвитку науки і техніки, економічних показників. Основні поняття: системний підхід, ретроспективна інформація, зовнішній та внутрішній фоні, облік альтернатив розвитку, аналогії. Види попиту на продукцію.

Зв'язок планування та прогнозування. Форми сполучення плану та прогнозу. Різниця між планом та прогнозом. Функції прогнозування.

Основні принципи топології прогнозів. Етапи прогнозування: ретроспекція, діагноз та перспекція. Види прогнозування.

### **Тема 2. Моделювання об'єктів прогнозування**

Класифікація об'єктів прогнозування. Основні ознаки класифікації. Задачі аналізу об'єктів прогнозування. Принципи аналізу об'єктів прогнозування. Інформаційне забезпечення прогнозної моделі. Види та джерела інформації. Класифікація моделей. Основні засоби вираження моделей. Вимоги до прогнозної моделі. Класифікація методів прогнозування. Основні етапи побудови прогнозної моделі.

### **Тема 3. Аналіз часових рядів. Оцінка точності прогнозу**

Часовий ряд економічних показників. Основні поняття рядів. Характеристики часових рядів: тенденція, автокореляція. Основні задачі аналізу часових рядів. Методи аналізу. Елементарні засоби опису часових рядів.

Якість системи планування та помилки прогнозу. Показники точності прогнозу. Середня абсолютна процентна помилка (MAPE),

середня процентна помилка (MPE), середньоквадратичне відхилення моделі.

#### **Тема 4. Трендові моделі прогнозування**

Обґрунтування тенденції розвитку. Вибір функції тренду. Розрахунок параметра функції тренду. Аналіз залишкового компонента динамічного ряду. Метод серії та медіан. Автокореляція. Прогнозування з допомогою трендової моделі. Розрахунок довірчих інтервалів. Помилка прогнозу.

Прогнозування циклічного поведіння економічного показника.

#### **Тема 5. Прогнозування за допомогою змінної середньої**

Поняття змінної середньої. Види фільтрів. Експоненціальна середня. Метод Р. Брауна, облік помилок прогнозу. Особливості короткострокового прогнозування попиту. Метод Д. Трігга та Р. Брауна, трекінг–сигнал.

#### **Тема 6. Авторегресивні моделі прогнозування**

Авторегресивні моделі прогнозування. Критерій присутності автокореляції. Визначення порядку моделі. Особливості застосування авторегресивних методів прогнозування.

#### **Тема 7. Статистичні методи прогнозування**

Регресія часових рядів. Поняття лага. Побудова моделі. Вирішення моделі. Оцінка результатів рішення.

Прогнозування за методом гармонійних вагів. Особливості застосування методу.

Прогнозування з допомогою ланцюгів Маркова.

#### **Тема 8. Експертні методи прогнозування**

Основні поняття експертних методів. Анкета. Методи опитування. Відбір експертів. Формування експертних груп. Колективні та

індивідуальні експертні оцінки. Способи обробки експертних оцінок. Метод колективної генерації ідеї («мозкового штурму»). Метод «Дельфі». Побудова сценаріїв та прогнозних графів.

## **4. Плани лекцій**

### **Змістовий модуль 1. Діагностика роботи підприємства**

#### **Тема 1. Сутність економічної діагностики підприємства**

- 1.1. Сутність та особливості економічної діагностики
- 1.2. Види діагностики
- 1.3. Інструментарій економічної діагностики

Література: основна [1,2, 3, 4, 5]; додаткова [10, 11, 12].

#### **Тема 2. Діагностика конкурентних позицій підприємства**

- 2.1. Діагностика конкурентного середовища
- 2.2. Діагностика конкурентоспроможності підприємства
- 2.3. Оцінка конкурентоспроможності продукції

Література: основна [1,2, 3, 4, 5]; додаткова [10, 11].

#### **Тема 3. Діагностика потенціалу підприємства та оцінка його стану**

- 3.1. Сутність і структура економічного потенціалу підприємства
- 3.2. Аналіз і оцінка стану економічного потенціалу

Література: основна [1,2, 3, 4]; додаткова [10, 11].

#### **Тема 4. Діагностика майна, ринкова ціна підприємства**

- 4.1. Вартість господарюючого суб'єкту: предмет, мета і принципи оцінки
- 4.2. Процедури і методи оцінки
- 4.3. Коригування вартості підприємства

Література: основна [1,2, 3, 4]; додаткова [10, 11].



## **Тема 5. Фінансова діагностика**

5.1. Основні положення фінансової діагностики та інструментарій її здійснення.

5.2. Діагностика підприємства за допомогою статистичної інформації

5.3. Діагностика підприємства за допомогою фінансових коефіцієнтів

Література: основна [1,2, 3, 4]; додаткова [10, 11].

## **Тема 6. Діагностика економічної безпеки підприємства**

6.1. Сутність економічної безпеки підприємства та основні її складові.

6.2. Методичні підходи до визначення рівня економічної безпеки

6.3. Заходи щодо забезпечення економічної безпеки підприємства

Література: основна [1,3, 4]; додаткова [10].

## **Тема 7. Діагностика економічної культури підприємства**

7.1. Сутність та елементи організаційної культури.

7.2. Моделі і типи організаційної культури

7.3. Методики оцінки організаційної культури підприємства

Література: основна [1]; додаткова [12].

## **Змістовий модуль 2. Прогнозування розвитку підприємства**

### **Тема 1. Сутність, основні поняття, метод та методика прогнозування**

1.1. Сутність та особливості прогнозування.

1.2. Основні поняття прогнозування.

1.3. Види прогнозів.

1.4. Етапи на функції.

1.5. Метод та методика прогнозування.

Література: основна [6, 7]; додаткова [13, 14, 15].

## **Тема 2. Моделювання об'єктів прогнозування**

2.1. Аналіз об'єктів прогнозування.

2.2. Інформаційне забезпечення об'єктів прогнозування.

2.3. Моделювання об'єктів прогнозування.

Література: основна [ 6, 7]; додаткова [14].

## **Тема 3. Аналіз часових рядів. Оцінка точності прогнозу**

3.1. Особливості часових рядів.

3.2. Оцінка точності прогнозу.

Література: основна [6, 7, 8]; додаткова [13, 14, 15].

## **Тема 4. Трендові моделі прогнозування**

4.1. Вибір та розрахунок параметрів функції тренда.

4.2. Обґрунтування залежності економічного показника від часу.

4.3. Остаточне обґрунтування функції тренду.

4.4. Аналіз залишкової компоненти часового ряду.

4.5. Оцінка автокореляції.

4.6. Прогнозування по тренду та розрахунок довірливих інтервалів.

Література: основна [6, 7, 8, 9]; додаткова [13, 14, 15].

## **Тема 5. Прогнозування за допомогою змінної середньої**

5.1. Основні поняття змінної середньої.

5.2. Прогнозування за допомогою змінної середньої.

5.3. Система автоматичного контролю прогнозування по методу Р. Брауна та Д.Трігга.

Література: основна [6, 7, 8, 9]; додаткова [13, 14, 15].

## **Тема 6. Авторегресивні моделі прогнозування**

6.1. Обґрунтування порядку авторегресивної моделі.

6.2. Методика рішення авто регресивних моделей.

Література: основна [6, 7, 8, 9]; додаткова [13, 14, 15].

## **Тема 7. Статистичні методи прогнозування**

7.1. Регресія часових рядів.

7.2. Прогнозування за допомогою ланцюгів Маркова.

7.3. Прогнозування за допомогою гармонійних ваг та головних компонент.

Література: основна [6, 7, 8]; додаткова [13, 14, 15].

## **Тема 8. Експертні методи прогнозування**

8.1. Основні поняття експертних методів.

8.2. Засоби обробки експертних оцінок.

8.3. Методи колективної генерації ідей.

8.4. Метод «Дельфі».

8.5. Методи сценаріїв та графів.

Література: основна [6]; додаткова [13, 14].

## **5. Плани лабораторних занять**

### **Теми лабораторних робіт**

Лабораторні заняття – форма навчального заняття, спрямована на закріплення студентом теоретичних знань, отриманих як на лекційних заняттях, так і в процесі самостійного вивчення матеріалу. На цих заняттях організується детальний розбір студентами окремих теоретичних положень навчальної дисципліни за допомогою прикладних програм ПЕОМ. Для цього розроблені ситуаційні лабораторні завдання та методичні вказівки до їх виконання. Успішне рішення завдань потребує певних знань використання програми Excel.

На лабораторних заняттях у студентів формуються практичні вміння та навички: аналізу та оцінки особливостей діяльності підприємства та розробки рішень щодо покращення ефективності його функціонування; застосування різних моделей прогнозування для рішення конкретних економічних задач по обґрунтуванню розвитку підприємства.

Кожний студент на лабораторних заняттях виконує свої індивідуальні завдання. Для їх успішного виконання треба попереднє ознайомитися с лекційним матеріалом по конкретній темі, а також знати

и використовувати при виконанні завдань пакетні програми. Краще усього використовують програму Excel.

По навчальній дисципліні виконується по модулю 1 «Діагностика діяльності підприємства» 9 лабораторних робіт:

перша, друга, третя по темі 2 «Діагностика конкурентних позицій підприємства»;

четверта, п'ята по темі 3 «Діагностика потенціалу підприємства та оцінка його стану»;

шоста по темі 4 «Діагностика майна, ринкова ціна підприємства»;

сьома по темі 5 «Фінансова діагностика»;

восьма по темі 6 «Діагностика економічної безпеки підприємства»;

дев'ята – комплексна підсумкова робота.

по модулю 2 «Прогнозування розвитку підприємства» 4 лабораторні роботи:

перша по темі 4 «Трендові моделі прогнозування»;

друга по темі 6 «Авторегресивні моделі прогнозування»;

четверта по темі 8 «Експертні методи прогнозування».

Перелік лабораторних робіт наведений у табл. 3.

Таблиця 3

### Перелік тем лабораторних занять за модулями

Назва завдання	Теми лабораторних робіт	Кількість годин	Література
<b>Змістовний модуль 1. Діагностика роботи підприємства</b>			
Завдання 1. Діагностика конкурентних позицій підприємства	Лабораторна робота 1. Аналіз конкурентного середовища підприємства. Аналіз привабливості галузі.	2	Основна: [1,2,3,4, 5]; додаткова: [10, 11, 12]
	Лабораторна робота 2. Оцінка конкурентоспроможності підприємства	2	Основна: [1,2,3,4, 5]; додаткова: [10, 11, 12]
	Лабораторна робота 3.	2	Основна:

		Визначення рівня конкурентоспроможності основних видів продукції підприємства		[1,2,3,4, 5]; додаткова: [10, 11, 12]
Завдання 2. Діагностика потенціалу підприємства		Лабораторна робота 4, 5. Оцінка економічного потенціалу підприємства та аналіз впливу його складових на загальний результат	4	Основна: [1,2,3,4, 5]; додаткова: [10, 11, 12]
Завдання 3. Оцінка вартості підприємства як цілісного майнового комплексу		Лабораторна робота 6. Визначення вартості підприємства за допомогою витратного, дохідного та порівняльного підходів.	2	Основна: [1,2,3,4, 5]; додаткова: [10, 11, 12]
Завдання 4. Фінансова діагностика стану підприємства		Лабораторна робота 7. Фінансовий аналіз діяльності підприємства. Горизонтальний, вертикальний аналіз, порівняльно – аналітичний аналіз балансу підприємства. Діагностика фінансового стану за допомогою фінансових коефіцієнтів.	2	Основна: [1,2,3,4, 5]; додаткова: [10, 11, 12]
Завдання 5. Діагностика економічної безпеки підприємства.		Лабораторна робота 8. Визначення рівня економічної безпеки підприємства з урахуванням основних складових	2	Основна: [1,2,3,4, 5]; додаткова: [10, 11, 12]
Завдання 6. Формування звіту	3	Лабораторна робота 9. Інтегральна оцінка стану підприємства	2	Основна: [1,2,3,4, 5]; додаткова:

проведення економічної діагностики підприємства			[10, 11, 12]
	Усього за модулем 1	18	
Змістовний модуль 2. Прогнозування розвитку підприємства			
Завдання 1. Обґрунтування трендову прогнозу модель збуту продукції	Лабораторні роботи 1, 2. Обґрунтувати моделі прогнозу збуту продукції. Визначати параметри моделей (лінійної та параболи) за допомогою програми Excel	4	Основна: [6, 7, 8, 9]; додаткова: [13, 14, 15]
	Лабораторна робота 3. Остаточний вибір прогнозу моделі за допомогою дисперсійного аналізу та показників точності прогнозу. Зробити висновки. Аналіз залишкової компоненті часового ряду методом серій та медіани	2	Основна: [6, 7, 8, 9]; додаткова: [13, 14, 15]
	Лабораторна робота 4. Оцінка автокореляції за допомогою коефіцієнтів автокореляції, критеріїв Джона фон Неймана та Дарбіна-Уотсона. Оцінити точність моделей. Побудувати прогнозу модель. Обґрунтувати прогноз та його довірчи інтервалі	2	Основна: [6, 7, 8, 9]; додаткова: [13, 14, 15]

Завдання 2. Обґрунтувати авторегресивну прогнозну модель збуту продукції	Лабораторна робота 5. Побудувати простішу авторегресивну модель. Розрахунок параметрів моделі. Оцінити автокореляцію. Побудувати прогноз по моделі	2	Основна: [6, 7, 8, 9]; додаткова: [13, 14, 15]
	Лабораторна робота 6. Побудувати двох параметричну авторегресивну модель. Оцінка моделі. Розрахунок прогнозу	2	Основна: [6, 7, 8, 9]; додаткова: [13, 14, 15]
Завдання 3. Обробка думок експертів	Лабораторна робота 7. Оцінка думок експертів за допомогою ранжювання, попарного порівняння.	2	Основна: [6, 7, 8, 9]; додаткова: [13, 14, 15]
	Лабораторна робота 8. Оцінка за допомогою коефіцієнта конкордації	2	Основна: [6, 7, 8, 9]; додаткова: [13, 14, 15]
	Усього за модулем 2	16	
	Усього по дисципліні	34	

## 6. Самостійна робота студентів

Самостійна робота студентів необхідна для успішного засвоєння матеріалу навчальної дисципліни. Вона складає із вивчення лекційного матеріалу та рекомендованої літератури, підготовки до лабораторних та лекційних занять, оформлення завдань, систематизація та самоконтроль засвоєння отриманих знань. У таблиці 4 наведений перелік питань для самостійного опрацювання.

## Перелік питань для самостійного опрацювання

Назва теми	Питання для самостійного опрацювання	Література
Змістовий модуль 1. Методи діагностики роботи підприємства		
1. Сутність економічної діагностики підприємства	Методи економічної діагностики.	Основна: [1,2,3,4, 5]; додаткова: [10, 11, 12]
2. Діагностика конкурентних позицій підприємства	Форми діагностики конкурентного середовища. Методи оцінки конкурентоспроможності підприємства.	Основна: [1,2,3,4, 5]; додаткова: [10, 11, 12]
3. Діагностика потенціалу підприємства та оцінка його стану	Управлінський аналіз. Види стратегічних ресурсів підприємства. Діагностика виробничого потенціалу підприємства.	Основна: [1,2,3,4, 5]; додаткова: [10, 11, 12]
4. Діагностика майна, ринкова ціна підприємства	Аналіз фінансово-господарської діяльності підприємства. Методи оцінки ринкової вартості господарюючого суб'єкта.	Основна: [1,2,3,4, 5]; додаткова: [10, 11, 12]
5. Фінансова діагностика	Діагностика підприємства за допомогою фінансових коефіцієнтів.	Основна: [1,2,3,4, 5]; додаткова: [10, 11, 12]
6. Діагностика економічної безпеки підприємства	Методи оцінки функціональних складових економічної безпеки підприємства.	Основна: [1,2,3,4, 5]; додаткова: [10, 11, 12]



7. Діагностика економічної культури підприємства	Методики оцінки організаційної культури підприємства	Основна: [1,2,3,4, 5]; додаткова: [10, 11, 12]
Змістовий модуль 2. Прогнозування розвитку підприємства		
1. Сутність, основні поняття, метод та методика прогнозування	1. Характеристики основних показників роботи підприємства. 3. Організації, які займаються прогнозуванням	Основна: [6, 7, 8, 9]; додаткова: [13, 14, 15]
2. Моделювання об'єктів прогнозування	1. Особливості об'єктів прогнозування. 2. Характеристики основних методів та моделей прогнозування	Основна: [6, 7, 8, 9]; додаткова: [13, 14, 15]
3. Аналіз часових рядів. Оцінка точності прогнозу	1. Оцінка точності прогнозу	Основна: [6, 7, 8, 9]; додаткова: [13, 14, 15]
4. Трендові моделі прогнозування	1. Особливості використання різних функцій у прогнозуванні. 2. Прогнозування циклічних процесів	Основна: [6, 7, 8, 9]; додаткова: [13, 14, 15]
5. Прогнозування за допомогою змінної середньої	1. Метод Р. Брауна та Тригга	Основна: [6, 7, 8, 9]; додаткова: [13, 14, 15]
6. Авторегресивні моделі прогнозування	1. Корелограми стаціонарного та нестаціонарного процесів	Основна: [6, 7, 8, 9]; додаткова: [13, 14, 15]
7. Статистичні моделі прогнозування	1. Регресивні моделі прогнозу 2. Особливості прогнозування за допомогою ланцюгів Маркова	Основна: [6, 7, 8, 9]; додаткова: [13, 14, 15]
8. Експертні методи	1. Колективні експертні оцінки	Основна:

прогнозування		[6]; додаткова: [13, 14]
---------------	--	--------------------------------

## 7. Контрольні запитання для самодіагностики

### Змістовий модуль 1. Методи діагностики роботи підприємства

1. Сутність економічної діагностики.
2. Види діагностики.
3. Послідовність проведення економічної діагностики.
4. Методи економічної діагностики.
5. Етапи діагностики конкурентного середовища.
6. Конкурентоспроможність підприємства.
7. SWOT-аналіз.
8. Стратегічні групи конкурентів.
9. Карта стратегічних груп.
10. Стратегічні можливості в галузі.
11. Показники оцінки конкурентоспроможності підприємства.
12. Конкурентоспроможність продукції.
13. Методи оцінювання конкурентоспроможності продукції.
14. Основні етапи оцінки конкурентоспроможності продукції.
15. Управлінська діагностика, її сутність.
16. Сутність виробничого потенціалу підприємства.
17. Етапи життєвого циклу виробничого процесу на підприємстві.
18. Показники оцінки елементів виробничого потенціалу підприємства.
19. Методи оцінки виробничого потенціалу на підприємстві.
20. Методи оцінки вартості підприємства.
21. Ризики та оцінка вартості підприємства.
22. Методи оцінки фінансового стану підприємства.
23. Етапи проведення фінансової діагностики.
24. Методи аналізу фінансової діагностики.
25. Зовнішні та внутрішні джерела загрози на підприємстві.
26. Кризові ситуації на підприємстві.
27. Методи діагностики економічної безпеки підприємства.

28. Функціональні складові економічної безпеки.
29. Етапи моніторингу стану та динаміки розвитку підприємства.
30. Складові організаційної культури.
31. Методи проведення культурологічної діагностики.
32. Корпоративні цінності та норми.
33. Елементи культури виробництва.
34. Типи організаційної культури підприємства.
35. Етапи побудови профілю організаційної культури підприємства.

## **Змістовий модуль 2. Прогнозування розвитку підприємства**

1. Особливості прогнозування.
2. Суть прогнозування та зв'язок з розвитком підприємства.
3. Розходження плану та прогнозу.
4. Основні поняття прогнозування.
5. Етапи прогнозування.
6. Функції прогнозування.
7. Види прогнозів.
8. Значення прогнозу збуду в розробці планів розвитку підприємства.
9. Комерційний прогноз та завдання, які він вирішує.
10. Завдання прогнозування розвитку підприємства.
11. Види попиту на продукцію підприємства.
12. Прогнози технічного розвитку та їхня роль в розвідку підприємства.
13. Сутність методу прогнозування.
14. Основні методологічні принципи прогнозування.
15. Суть ретроспективного аналізу.
16. Взаємозв'язок прогнозу та плану.
17. Назвіть основні принципи топології прогнозу.
18. Назвіть види моделей прогнозування.
19. Аналіз об'єктів прогнозування.
20. Основні вимоги до побудови прогнозної моделі.
21. Види та джерела інформації.
22. Характеристика методів прогнозування.
23. Характеристика часових рядів.
24. Показники точності прогнозів.

25. Роль детермінованої та випадкової складових часового ряду в прогнозуванні економічних процесів.
26. Розрахунок прогнозу та його помилки в короткостроковому прогнозуванні.
27. Вибір функції тренду.
28. Розрахунок параметрів тренду.
29. Аналіз залишкової компоненти часового ряду.
30. Оцінка автокореляції.
31. Особливості згладжування.
32. Метод Р. Брауна, його сутність.
33. Трекінг-сигнал, діапазон його змінення.
34. Методика прогнозування за допомогою трекінг-сигналу.
35. Сутність авторегресивної моделі.
36. Порядок авторегресивної моделі.
37. Показники, які використовуються для оцінки автокореляції у авторегресивних моделях.
38. Сутність регресії часових рядів.
39. Відбір факторів-аргументів.
40. Оцінка взаємозв'язків показників у регресивних моделях.
41. Показники оцінок точності прогнозу у регресивних моделях.
42. Коли використовуються експертні методи?
43. Як відбираються експерти?
44. Що таке анкети і як вона будується?
45. Назвати методи обробки експертних оцінок.
46. Сутність методу колективної генерації ідей.
47. Особливості методу «Дельфі».
48. Метод мозкового штурму.
49. Особливості методу розробки сценаріїв.
50. Сутність прогнозного графу та його використання в прогнозуванні.

## **8. Індивідуально-консультативна робота**

Індивідуально-консультативна робота складається з таких форм: індивідуальні заняття, консультації, перевірка виконання індивідуальних завдань, перевірка завдань поточного контролю.

Для підвищення ефективності організації індивідуально-консультаційної роботи проводяться:

- консультації індивідуальні (запитання-відповідь) і групові (розгляд типових ситуацій), перевірка завдань поточного контролю для оцінки засвоєння теоретичного матеріалу;
- консультації індивідуальні і групові для оцінки засвоєння матеріалу лабораторних робіт;
- індивідуальні захисти лабораторних завдань для комплексної оцінки засвоєння програмного матеріалу.

## 9. Методика активізації процесу навчання

Для активізації навчально-пізнавальної діяльності студентів при викладанні навчальної дисципліни **«Методи діагностики та прогнозування розвитку підприємства»** передбачено застосування таких навчальних технологій, як: проблемні лекції, робота в малих групах; використання спеціальних комп'ютерних програм.

Конкретні напрямки активізації процесу навчання розроблені з обліком особливостей навчальної дисципліни «Методи діагностики та прогнозування розвитку підприємства». Студенти у даному курсі вивчають різні методи аналізу та прогнозування економічних показників та процесів, які знаходять використання на практиці у розробки напрямку розвитку підприємства. Тому для активізації процесу навчання у лекціях викладається практика рішення окремих проблем за допомогою економіко-математичних та статистичних методів.

**Проблемні лекції** (питання) спрямовані на розвиток логічного мислення студентів. При цьому лектор задає запитання, які спонукають студентів шукати рішення проблемної ситуації, використовуючи при цьому вивчений раніше лекційний та практичний матеріал, як по даній дисципліні, так і по суміжним. Коло питань теми лекції обмежується двома-трьома ключовими моментами, які не знайшли відображення в підручниках. Також при викладанні лекційного матеріалу студентам пропонують питання для самостійного розміркування.

Необхідно на початку проведення проблемної лекції чітко сформулювати проблему, яку будуть вирішувати студенти. При викладанні лекційного матеріалу слід уникати прямої відповіді на

поставлені запитання, давати змогу студентам самостійно вирішити поставлену проблему. У кінці лекції обговорити зі студентами проблему, дав їм можливість висловити своє бачення рішення її.

**Робота в малих групах** дає змогу структурувати лекційні або лабораторні заняття за формою і змістом, створює можливості для участі кожного студента в роботі за темою заняття.

Таблиця 5

**Використання навчальних технологій  
для активізації процесу навчання**

Методики активізації процесу навчання	Практичне використання навчальних технологій
Проблемні лекції (питання) спрямовані на розвиток креативного мислення і творчого підходу при вивченні моделей та методів прогнозування	Проблемні питання: «Сучасні оцінки конкурентоспроможності на ринку» за темою 2; «Моделі організаційної культури на вітчизняних підприємствах» за темою 7, а також за темами 3 та 6; «Метод головних компонент та його використання в розробки стратегії розвитку підприємства» за темою 7 «Статистичні методи прогнозування», а також за темами 6 та 8.
Робота в малих групах дає змогу структурувати лабораторні заняття за допомогою комп'ютерних програм, створює можливості для участі кожного студента в роботі за комп'ютером	Робота в малих групах при проведенні усіх лабораторних занять допоможе прискорити процес навчання, розширити коло розв'язуваних проблем, підвищити надійність результатів рішення

## **10. Системі поточного і підсумкового контролю знань студентів**

Система оцінювання знань, вмінь та навичок студентів враховує різні види занять згідно з програмою навчальної дисципліни "Методи діагностики та прогнозування розвитку підприємства". Ця програма передбачає лекційні та лабораторні заняття, а також самостійну роботу.

### **Контроль систематичного виконання самостійних робіт та активності на лабораторних заняттях**

Контрольні заходи включають поточний і підсумковий модульні контролю.

Перевірка та оцінювання знань студентів проводиться в наступних формах:

1. Оцінювання знань студента під час лекційних і лабораторних занять.
2. Проведення поточного модульного контролю.
3. Проведення підсумкового модульного контролю.

Загальна модульна оцінка з дисципліни визначається як середнє арифметичне проміжних модульних оцінок.

Для одержання модульної оцінки треба мати 2 проміжні оцінки, які студент отримує під час лабораторних та лекційних занять, згідно з графіком навчального процесу.

Оцінювання знань лабораторного та лекційного складових модульного контролю проводиться за 12-бальною шкалою за такими критеріями:

- 1) розуміння, ступінь засвоєння теорії та методології проблем, що розглядаються;
- 2) ступінь засвоєння фактичного матеріалу навчальної дисципліни;
- 3) ознайомлення з рекомендованою літературою, а також із сучасною літературою з питань, що розглядаються;
- 4) вміння поєднувати теорію з практикою при розгляді виробничих ситуацій, розв'язанні задач, проведенні розрахунків при виконанні завдань, винесених для самостійного опрацювання, та завдань, винесених на розгляд в аудиторії;
- 5) логіка, структура, стиль викладу матеріалу в письмових роботах і при виступах в аудиторії, вміння обґрунтовувати свою позицію,

здійснювати узагальнення інформації та робити висновки.

### **Проміжний модульний контроль**

Проміжні оцінки складаються із двох частин: лабораторну та лекційну.

Під час лабораторних занять виставляється оцінка за лабораторну складову модульного контролю.

Оцінювання знань студента під час лабораторних занять має ціль: перевірку рівня підготовленості студента до виконання конкретної виробничої ситуації;

при цьому ураховується також активність, систематичність та результативність роботи студента протягом семестру над вивченням програмного матеріалу дисципліни;

відвідування занять;

самостійності та своєчасності здачі виконаних завдань викладачу (згідно з графіком навчального процесу).

Оцінка буде знижена (на розсуд викладача), якщо якась із вимог не буде виконана.

На лекційних та лабораторних заняттях також проводиться контроль систематичного виконання самостійної роботи.

Лекційний тестовий контроль здійснюється в письмовій формі.

**Проміжний тестовий контроль** проводиться двічі за семестр і передбачає виявлення опанування студентом матеріалу та вміння його застосувати для вирішення практичної ситуації.

При проведенні поточного тестування визначається рівень знань студентів з теоретичних питань навчальної дисципліни.

### **Структура тестових завдань**

Тестові завдання мають теоретичну та практичну частини різної рівня складності і охоплюють провідні теми, які вивчаються в межах навчальної дисципліни «Методи діагностики та прогнозування розвитку підприємства».

При цьому тестове завдання може містити як запитання, що стосуються теоретичного матеріалу, так і запитання, спрямовані на вирішення невеликої практичної ситуації.



Формат тестових завдань поділяється на завдання закритої та відкритої форми. Тестові завдання закритої форми мають відповіді, із яких вибирають одну правильну. На тестові завдання відкритої форми студент має дати вільну відповідь.

Також тестові завдання розрізняються за принципом побудови відповіді.

*Альтернативні* тестові завдання передбачають наявність двох варіантів відповіді типу "так-ні", "вірно-невірно" тощо. Їх використовують для перевірки правильності вибору або прийняття рішення в згорнутій формі.

Тестові завдання *на порівняння і протиставлення (на аналіз взаємозв'язку)* рекомендуються для перевірки вмінь виявляти розпізнавальні ознаки різних явищ, ситуацій тощо.

Тестові завдання з *множинними відповідями* "вірно-невірно" передбачають, що відповіді або рішення можуть бути тільки вірними або невірними. За ними тестується глибина знань, розуміння різних аспектів явищ, процесів тощо.

Тестові завдання *на визначення причинної залежності* використовуються при необхідності перевірки розуміння певної причинної залежності між двома явищами. Спочатку необхідно визначити, вірно чи невірно кожне з двох тверджень окремо, а лише потім, якщо обидва невірні, визначити правильна чи неправильна причинна залежність між ними.

Тестові завдання *на відтворення правильної послідовності*, які потребують переструктурування даних або елементів будь-якої комбінації, використовуються в разі тестування вмінь та знань правильної послідовності дій (нормативної діяльності), алгоритмів діяльності, технологічних прийомів тощо, а також знань загально прийнятих формулювань, визначень, правил, законів, фрагментів нормативних документів.

Тестові завдання *відкритого типу* передбачають вільні відповіді на завдання без запропонованих варіантів відповідей, і використовуються для виявлення знань термінів, визначень, понять.

Тестові завдання для проміжного тестового контролю обираються за відповідними модулями з загального переліку.

Проміжний тестовий контроль здійснюється при виконанні контрольної роботи, що складається з 5 питань. Далі наведений зразок модульного тестового завдання.

### **Зразок модульного тестового завдання по модулю 1:**

- 1) визначити об'єкт діагностики;
- 2) назвати етапи SWOT-аналізу;
- 3) назвати складові інтегрального показника: якості товару; якості сервісу у споживачів;
- 4) назвати типи організаційної культури;
- 5) назвати типи конкурентної позиції підприємства та надати характеристику кожної з позицій.

### **Зразок модульного тестового завдання по модулю 2:**

- 1) назвати етапи прогнозування;
- 2) назвати основні характеристик часових рядів;
- 3) оцінити автокореляцію за допомогою критерію Джона фон Неймана: для таких значень остатків: -1; 2; -3; 1; 0; 1.
- 4) якщо коефіцієнт кореляції менше табличного, то існує залежність економічного показника від часу;
- 5) оцінити значність коефіцієнта кореляції за допомогою квантіля, якщо коефіцієнт кореляції 0,8, об'єм вибірки дорівнює 100.

Критерії оцінок проміжного тестового контролю такий:

5 питань - 11-10 балів;

4 питання – 9-7 балів;

3 питання - 6-5 балів;

2 питання – 5 - 4балів;

1питання – 3-4 балі.

Відповіді студентів оцінюються за 12 бальною системою згідно з кваліфікаційними вимогами до бакалаврів напрямку підготовки «Менеджмент». Кожне завдання модульного контролю оцінюється окремо.

**Оцінка 12 балів** ставиться за глибоке засвоєння програмного матеріалу, застосування для відповіді не тільки рекомендованої, а й додаткової літератури та творчого підходу; чітке володіння понятійним апаратом, методами, методиками та інструментами аналізу стану та прогнозування діяльності підприємства, вміння використовувати їх для виконання конкретних практичних завдань, розв'язання ситуацій. Оформлення відповіді повинно бути акуратним, логічним та послідовним.

**Оцінка 11 балів** ставиться за глибоке засвоєння програмного матеріалу, засвоєння рекомендованої літератури; чітке володіння понятійним апаратом, методами, методиками та інструментами аналізу стану та прогнозування діяльності підприємства, вміння використовувати їх для виконання конкретних практичних завдань, розв'язання ситуацій. Оформлення відповіді повинно бути акуратним, логічним та послідовним.

**Оцінка 10 балів** ставиться за повне засвоєння програмного матеріалу та рекомендованої літератури; чітке володіння понятійним апаратом, методами, методиками та інструментами аналізу стану та прогнозування діяльності підприємства, вміння використовувати їх для виконання конкретних практичних завдань, розв'язання ситуацій. Допускаються незначні випадкові погрішності, які суттєво не впливають на повноту та змістовність відповіді.

**Оцінка 9 балів** ставиться за повне засвоєння програмного матеріалу та наявне вміння орієнтуватися в ньому, усвідомлене застосування знань для розв'язання практичних задач; при наявності незначних арифметичних помилок (тобто методичний підхід до вирішення задачі є правильним, але допущені незначні неточності у розрахунках певних показників) або не зовсім повних висновків за одержаними результатами розв'язання задачі. Оформлення виконаного завдання має бути охайним.

**Оцінка 8 балів** ставиться за повне засвоєння програмного матеріалу та наявне вміння орієнтуватися в ньому, усвідомлене застосування знань для розв'язання практичних задач. Практичні завдання виконуються в цілому правильно з використанням типового алгоритму, але при їх виконанні студент припускається окремих помилок. Оформлення виконаного завдання має бути охайним.

**Оцінка 7 балів** ставиться, якщо студент при виконанні практичних завдань ефективно застосовує основні знання навчального матеріалу, що передбачені навчальною програмою. Практичні завдання виконуються з цілому правильно з використанням типового алгоритму, але при їх виконанні студент припускається значних помилок.

**Оцінка 6 балів** ставиться за недостатнє вміння застосовувати теоретичні знання для розв'язання практичних задач; за умови, якщо завдання з основному виконане та мету завдання досягнуто, а студент при відповіді продемонстрував розуміння основних положень матеріалу навчальної дисципліни.

**Оцінка 5 балів** ставиться за часткове вміння застосовувати теоретичні знання для розв'язання практичних задач; за умови, якщо завдання частково виконане, а студент при відповіді продемонстрував розуміння основних положень матеріалу навчальної дисципліни.

**Оцінка 4 бали** ставиться у випадках, якщо студент при виконанні лабораторних завдань без достатнього розуміння застосовує навчальний матеріал, припускається суттєвих помилок, стикається з труднощами при виконанні основних положень матеріалу навчальної дисципліни.

**Оцінка 3 бали** ставиться студенту за невиконання значної частини завдання, стикається зі труднощами при викладанні основних положень матеріалу навчальної дисципліни.

**Оцінка 2 бали** ставиться студенту, що не опанував програмний матеріал, не може правильно виконати лабораторні завдання, стикається зі значними труднощами при викладанні основних положень матеріалу навчальної дисципліни.

**Оцінка 1 бал** ставиться за невиконання завдання загалом.

Підсумкова оцінка з дисципліни складається як середня з кількох складових, що враховує оцінки кожного виду контролю.

Підсумкова оцінка з дисципліни згідно з Методикою переведення показників успішності знань студентів Університету в систему оцінювання за шкалою ECTS конвертується в підсумкову оцінку за шкалою ECTS (табл. 6).

Таблиця 6

**Переведення показників успішності знань студентів  
У систему оцінювання за шкалою ECTS**

Відсоток студентів. Які зазвичай успішно досягають відповідної оцінки	Оцінка за шкалою ECTS		Оцінка за бальною шкалою, що використовується в ХНЕУ	Оцінка за національною шкалою
10	відмінне виконання	A	12-11	відмінно
25	вище середнього рівня	B	10	
30	взагалі робота правильна, але з певною кількістю помилок	C	9-7	добре
25	непогано, але зі значною кількістю недоліків	D	6	задовільно
10	виконання задовольняє мінімальні критерії	E	5-4	
-	потрібне повторне перескладання	FX	3	незадовільно
-	повторне вивчення дисципліни	F	2-1	

## **11. Рекомендована література**

### **11.1. Основна**

#### **Змістовий модуль 1. Методи діагностики роботі підприємства**

1. Афанасьев Н.В. Экономика предприятия: Учебно-методическое пособие для самостоятельного изучения дисциплины / Н.В. Афанасьев, А.Б. Гончаров [Под ред. проф. Н.В. Афанасьева]. – Харьков: ИД “ИНЖЭК”, 2004. – 410 с.
2. Васина А.А. Финансовая диагностика и оценка проектов. – СПб.: Питер, 2004. – 448 с.
3. Глазов М.М. Анализ и диагностика финансово-хозяйственной деятельности предприятия: Учебник для студентов ВУЗов. – СПб.: андреевский издательский дом, 2006. – 448 с.
4. Грунин О.А. Экономическая безопасность организации. – СПб.: Питер, 2002. – 160 с.
5. Иванов Ю.Б. Конкурентоспособность предприятия: оценка, диагностика, стратегия / Ю.Б. Иванов, А.Н. Тищенко, Н.А. Дробитько, О.С. Абрамова; Под ред. проф. Ю.Б. Иванова. – Х.: Изд-во ХНЭУ, 2004. – 256 с.

#### **Змістовий модуль 2. Прогнозування розвитку підприємства**

6. Клебанова Т. С. Методы прогнозирования. Учебное пособие / Т. С. Клебанова, В. В. Иванов, Н. А. Дубровина. – Харьков: Изд. ХГЕУ, 2002. – 372 с.
7. Федосеев В. В. Экономико-математические методы и прикладные модели: Учеб. пособие для вузов / В. В. Федосеев, А. Н. Гармаш, Д. М. Дайитбегов и др.; под ред. В. В. Федосеева. – М.: ЮНИТИ, 1999. - 392 с.
8. Эконометрика: Ученик / И. И. Елисеева, С. В. Курышева, Т. В. Костеева и др.; под ред. И. И. Елисеевой. - 2-е изд., перераб. и доп. – М.: Финансы и статистика, 2005. - 576 с.
9. Егоршин. А. А. Практикум по эконометрии в EXCEL: Учебное пособие для экономических вузов / А. А. Егоршин, Л. М. Малярец. – Харьков: ИД»ИНЖЭК», 2005. – 100 с.

## 11.2. Додаткова

### Змістовий модуль 1. Методи діагностики роботі підприємства

10. Вартанов А.С. Экономическая диагностика деятельности предприятия: организация и методология. – М.: Финансы и статистика, 1991. – 80 с.
11. Забродский В.А. Диагностика фмнансовой устойчивости функционирования производственно-экономических систем / В.А. Забродский, Н.А. Кизим. – Харьков: Бизнес-Информ, 2000. – 108 с.
12. Камерон К. Диагностика и изменение организационной культуры / Пер. с англ. К. Камерон, Р. Куинн; Под ред. И.В. Андреевой. – СПб.: Питер, 20-1. – 320 с.

### Змістовий модуль 2. Прогнозування розвитку підприємства

13. Горчаков А. А., Орлова И. В. Компьютерные экономико-математические модели. – М.: Компьютер, ЮНИТИ, 1995. – 136 с.
14. Орлова И. Экономико-математические методы и модели. Выполнение в EXCEL. – М.: Финстатинформ, 2000. – 136 с.
15. Чекотовський Е. Графічний метод у статистиці (на основі EXCEL). – К.: Знання, 2000. 518 с.

## Зміст

Вступ .....	3
1. Кваліфікаційні вимоги до студентів.....	5
2. Тематичний план навчальної дисципліни	8
3. Зміст навчальної дисципліни за модулями та темами.....	10
4. Плани лекцій .....	16
5. Плани лабораторних занять	19
6. Самостійна робота студента.....	23
7. Контрольні питання для самодіагностики.....	26
8. Індивідуально-консультаційна робота.....	28
9. Методика активізації процесу навчання.....	29
10. Система поточного і підсумкового контролю .....	31
11. Рекомендована література.....	38
11.1. Основна.....	38
11.2. Додаткова .....	39



## НАВЧАЛЬНЕ ВИДАННЯ

Робоча програма навчальної дисципліни  
«Методи діагностики та прогнозування розвитку підприємства»  
для студентів напряму підготовки  
«Менеджмент»  
денної форми навчання

Укладач **Омеласенко Ніна Миколаївна;**  
**Тонева Кристина Валер'ївна;**  
**Пономаренко Олена Едуардівна**

Відповідальний за випуск **Ястремська О. М.**

Редактор  
Коректор

План 2012 р. Поз. №

Підп. до друку Формат 60x90 1/16 Папір. MultiCopy. Друк Riso.

Ум. - друк. арк. Обл.- вид. арк. Тираж прим. Зам. №

---

Свідоцтво про внесення до Державного реєстру суб'єктів видавничої  
справи Дк № 481 від 13.06.2001 р.

Видавець і виготівник – видавництво ХНЕУ, 61001, м. Харків, пр.  
Леніна,9а