

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ

**ХАРКІВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ ЕКОНОМІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ІМЕНІ СЕМЕНА КУЗНЕЦЯ**

**Робоча програма
навчальної дисципліни**

**"ОБҐРУНТУВАННЯ ГОСПОДАРСЬКИХ
РІШЕНЬ І ОЦІНЮВАННЯ РИЗИКІВ"**

**для студентів напряму підготовки
6.030504 "Економіка підприємства"**

Харків. Вид. ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2014

Затверджено на засіданні кафедри економіки підприємства та менеджменту.

Протокол № 2 від 31.08.2013 р.

Укладачі: Афанасьєв М. В.
Кулєшова Н. В.

P58 Робоча програма навчальної дисципліни "Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків" для студентів напряму підготовки 6.030504 "Економіка підприємства" / укл. М. В. Афанасьєв, Н. В. Кулєшова. – Х. : Вид. ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2014. – 72 с. (Укр. мов.)

Подано тематичний план навчальної дисципліни та її зміст за модулями й темами. Вміщено плани лекцій, практичних, лабораторних та семінарських занять, матеріали для закріплення знань (самостійну роботу, контрольні запитання), методичні рекомендації щодо оцінювання знань студентів, професійні компетентності, якими повинен володіти студент після вивчення дисципліни.

Рекомендовано для студентів напряму підготовки 6.030504 "Економіка підприємства".

Вступ

Сучасні економічні умови, в яких функціонують вітчизняні підприємства, характеризуються високим рівнем невизначеності та динамічності чинників зовнішнього середовища. Усе це сприяє виникненню несприятливих ситуацій, що супроводжуються конфліктністю економічних інтересів і відсутністю повної та достовірної інформації. У таких умовах важливістю набуває вміння керівників адаптувати діяльність підприємства до змін зовнішнього середовища та приймати науково обґрунтовані, оптимальні рішення з метою ведення ефективної господарської діяльності підприємства. Можливість досягнення цього обумовлюється ґрунтовною фаховою підготовкою майбутніх фахівців-економістів та керівників підприємства, яка враховує всі аспекти сучасної практики господарювання.

Навчальна дисципліна "Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків" (ОГРіОР) є нормативною навчальною дисципліною та вивчається згідно з навчальним планом підготовки фахівців освітньо-кваліфікаційного рівня "бакалавр" напряму підготовки 6.030504 "Економіка підприємства".

1. Опис навчальної дисципліни

Найменування показників	Галузь знань, напрям підготовки, освітньо-кваліфікаційний рівень	Характеристика навчальної дисципліни	
		денна форма навчання	заочна форма навчання
Кількість кредитів – 5	Галузь знань 0305 "Економіка та підприємництво"	Нормативна	
Модулів – 2	Напрямок підготовки 6.030504 "Економіка підприємства"	Рік підготовки	
Змістових модулів – 2		4-й	5-й
Індивідуальне науково-дослідне завдання: "Формування ефективних господарських рішень на підприємстві з урахуванням ризику"		Семестр	
Загальна кількість годин – 180		7-й	9-й
		Лекції	
Тижневих годин для денної форми навчання: аудиторних – 4; самостійної роботи студента – 6	Освітньо-кваліфікаційний рівень: бакалавр	34 год	26 год
		Практичні, семінарські	
		30 год	18 год
		Лабораторні	
		4 год	–
		Самостійна робота	
		108 год	132 год
		у тому числі ІНДЗ	
		18 год	
		Вид контролю	
		екзамен	
4 год	4 год		

Примітка. Співвідношення кількості годин аудиторних занять до самостійної і індивідуальної роботи становить:

для денної форми навчання – 67 %;

для заочної форми навчання – 36 %.

2. Мета та завдання навчальної дисципліни

Метою викладання даної навчальної дисципліни є формування знань і навичок стосовно обґрунтування господарських рішень з різним ступенем невизначеності та ризику.

Для досягнення мети поставлені такі основні **завдання**:

засвоєння основних принципів обґрунтування різних видів господарських рішень, методичних підходів до аналізу ризику та управління ним;

оволодіння навичками самостійного здійснення аналізу, ідентифікації та оцінювання ризику з використанням комп'ютерної техніки та програмно-математичних комплексів.

"Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків" – навчальна дисципліна, що вивчає інструментарій економічного обґрунтування й прийняття господарських рішень з урахуванням мінливості зовнішнього середовища.

Об'єктом навчальної дисципліни є економічна система та процеси, що відбивають різні аспекти прийняття господарських рішень.

Предметом навчальної дисципліни є господарські рішення та пов'язані з ними ризики на підприємстві.

Вивчення даної навчальної дисципліни студент розпочинає, прослухавши більшість навчальних дисциплін гуманітарного та професійного циклів. Теоретико-методологічною базою вивчення цієї дисципліни є такі навчальні дисципліни, як: "Макроекономіка", "Мікроекономіка", "Економіка підприємства", "Менеджмент", "Економічний аналіз", "Оптимізаційні методи та моделі", "Економетрика", "Статистика". У свою чергу, знання з даної дисципліни забезпечують успішне засвоєння таких навчальних дисциплін, як: "Управління проектами", "Економічне управління підприємством", "Управління стратегічними змінами", "Обґрунтування та експертиза бізнес-проектів", а також виконання тренінгів, міждисциплінарних комплексних курсових робіт, бакалаврських та магістерських дипломних робіт.

У процесі навчання студенти отримують необхідні знання під час лекційних занять та виконання практичних завдань. Найбільш складні питання

винесено на розгляд і обговорення під час семінарських занять. Також велике значення в процесі вивчення та закріплення знань має самостійна робота студентів. Усі види занять розроблені відповідно до кредитно-модульної системи організації навчального процесу.

У результаті вивчення навчальної дисципліни студент повинен:

знати:

понятійний та категорійний апарат щодо обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків на підприємстві;

економічну сутність та основні види господарських рішень;

основні принципи та підходи до обґрунтування господарських рішень у різних умовах функціонування підприємства (визначеності, невизначеності, ризику);

критерії якості та ефективності обґрунтування господарських рішень;

технологію розробки та прийняття оптимальних господарських рішень;

сучасні економіко-математичні методи та моделі обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків;

природу виникнення невизначеності та ризиків, їх різновиди і вплив на якість господарських рішень;

теоретичні аспекти ризик-менеджменту;

напрями регулювання та методи зниження підприємницьких ризиків;

вміти:

проводити ідентифікацію та аналіз ключових проблем на підприємстві; обґрунтовано визначати оптимальні форми подання та реалізації господарських рішень;

оцінювати рівень ризику підприємницької діяльності з використанням економіко-математичних методів;

проводити прогнозування та аналіз господарських рішень;

застосовувати економіко-математичні методи та моделі в процесі розробки і прийняття господарських рішень;

здійснювати обґрунтований вибір оптимального господарського рішення на підставі критеріїв в умовах визначеності, невизначеності та ризиків;

здійснювати комплексне оцінювання підприємницьких ризиків із застосуванням сучасних програмних засобів.

У процесі викладання навчальної дисципліни основна увага приділяється оволодінню студентами професійними компетентностями, що наведені в табл. 2.1.

**Професійні компетентності, які отримують студенти після вивчення
навчальної дисципліни**

Код компетентності	Назва компетентності	Складові компетентності
ОГРiOP 1	Приймати оптимальні господарські рішення в умовах визначеності, невизначеності, ризику та конфлікту	Визначати оптимальні господарські рішення в умовах невизначеності
		Визначати оптимальні господарські рішення в умовах ризику
		Визначати оптимальні господарські рішення в умовах конфлікту
		Проводити аналіз впливу невизначеності на якість прийняття господарських рішень
ОГРiOP 2	Розробляти ефективні рішення з використанням економіко-математичних методів та моделей	Визначати способи формалізації та реалізації господарських рішень
		Здійснювати обґрунтований вибір економіко-математичних методів та моделей для формування ефективних господарських рішень
		Застосовувати методи експертних оцінок для визначення ступеня ризику
		Здійснювати оцінку абсолютного рівня ризику
		Прогнозувати господарські рішення з урахуванням впливу чинників зовнішнього середовища
		Визначати схильність ОПР до ризику з використанням теорії корисності
ОГРiOP 3	Здійснювати обґрунтування прийняття господарських рішень та їх реалізацію	Ідентифікувати підприємницькі ризики
		Визначати технологію розробки та реалізації господарських рішень
		Визначати інтегральні показники оцінки ризику фінансово-господарської діяльності підприємства
		Здійснювати оцінку ефективності портфелів цінних паперів з урахуванням ризику
		Формувати напрями зниження ступеня ризику діяльності підприємства
		Формувати напрями підвищення ефективності господарських рішень

Структуру складових професійних компетентностей та їх формування відповідно до Національної рамки кваліфікацій України наведено в додатку А.

3. Програма навчальної дисципліни

Змістовий модуль 1.

Теоретичні та методологічні засади прийняття господарських рішень

Тема 1. Сутнісна характеристика господарських рішень

1.1. Господарські рішення, їх сутність та класифікація.

Поняття господарських рішень та їх ознаки. Елементи прийняття рішень. Сутність господарських рішень. Класифікація господарських рішень. Чинники, що впливають на якість прийняття господарських рішень. Вимоги до господарських рішень та умови їх досягнення.

1.2. Способи формалізації та реалізації господарських рішень.

Основні форми вираження господарських рішень, їх зміст. Форми реалізації господарських рішень.

1.3. Параметри та умови забезпечення якості й ефективності господарських рішень.

Якість господарських рішень. Основні параметри та показники якісного рішення. Процес управління та формування господарського рішення. Умови забезпечення якості господарського рішення. Чинники якості господарських рішень. Види ефективності господарських рішень. Основні вимоги до господарських рішень. Принципи оцінювання ефективності господарських рішень.

Тема 2. Технологія прийняття рішень господарської діяльності

2.1. Основні етапи прийняття рішень.

Підготовка господарського рішення. Прийняття господарського рішення. Реалізація господарського рішення. Статичні та динамічні завдання прийняття господарських рішень.

2.2. Стадії прийняття господарських рішень.

Сутність та основні цілі процесу дивергенції, трансформації та конвергенції прийняття господарських рішень. Умови забезпечення трансформації системи. Основні методи конвергенції.

2.3. Основні моделі та засоби прийняття рішень.

Алгоритм рішення. Діаграма у вигляді риб'ячого скелету (метод Ішікави). Блок-схема (блок-діаграма). Процес складання карт ("ґрунтовка"). Уявні схеми. Метод ABC. Кольорове кодування.

2.4. Характер та умови прийняття господарських рішень.

Основний зміст інтуїтивних рішень. Рішення, що засновані на судженнях, та їх види. Сутність раціональних рішень. Класична, поведінкова та ірраціональна моделі прийняття рішень. Умови прийняття господарських рішень (визначеність, невизначеність, ризик).

Тема 3. Методичні основи підготовки господарських рішень

3.1. Неформалізовані методи прийняття господарських рішень.

Суть евристичних методів. Методи експертних оцінок в організації розробки господарських рішень: метод комісій, метод "мозкової атаки", метод сценаріїв, метод Дельфі. Статистична обробка експертної інформації: метод аналізу ієрархії.

3.2. Формалізовані методи прийняття господарських рішень.

Сутність поняття "метод". Основне призначення економіко-математичних методів у процесі прийняття господарських рішень. Зміст методів математичного програмування. Сутність кореляційного та регресійного аналізів. Застосування методів математичного програмування у процесі визначення оптимального господарського рішення. Застосування методів багатовимірного аналізу у процесі розробки та прийняття господарських рішень.

3.3. Моделювання в теорії прийняття рішень.

Основні поняття теорії моделювання. Елементи моделювання. Класифікація математичних моделей прийняття господарських рішень. Процес побудови моделей прийняття господарських рішень.

Тема 4. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання їх ефективності

4.1. Методичні основи обґрунтування господарських рішень.

Сутність обґрунтування господарських рішень. Чинники, що впливають на вибір методу обґрунтування господарських рішень. Критерії оцінки вибору методу обґрунтування господарських рішень. Критерії оцінки обґрунтування господарських рішень. Принципи обґрунтування господарських рішень.

4.2. Методологічні основи оцінки ефективності господарських рішень.

Основні цілі оцінки ефективності обґрунтування господарських рішень. Абсолютна та відносна ефективність. Вимоги до оцінки ефективності господарських рішень. Критерії оцінки ефективності господарських рішень. Методи оцінки ефективності господарських рішень. Фактори, що впливають на ефективність господарського рішення.

Тема 5. Прогнозування та аналіз господарських рішень

5.1. Сутність прогнозування господарських рішень.

Поняття та основна мета прогнозування. Завдання прогнозування. Характеристика процесу прогнозування господарських рішень. Основні етапи прогнозування господарських рішень. Принципи прогнозування господарських рішень. Функції прогнозування. Основні джерела інформації та методи її отримання для побудови прогнозів.

5.2. Методи прогнозування господарських рішень.

Поняття методу прогнозування. Класифікація методів прогнозування господарських рішень. Інтуїтивні методи прогнозування. Формалізовані методи прогнозування. Комбіновані методи прогнозування. Основні чинники, що впливають на вибір методу прогнозування господарських рішень.

5.3. Методи аналізу господарських рішень.

Визначення поняття аналізу господарських рішень. Ключові принципи аналізу господарських рішень. Зміст основних методів аналізу господарських рішень (метод порівнянь, індексний метод, балансовий метод, метод ланцюгових підстановок, графічний метод).

Тема 6. Невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності

6.1. Сутність та природа невизначеності.

Сутність поняття "невизначеність". Джерела невизначеності. Ієрархія видів невизначеності. Поверхнева та глибинна невизначеність. Класифікація причин виникнення невизначеності. Шляхи зниження невизначеності.

6.2. Методи опису невизначеності.

Імовірний метод опису невизначеності. Сутність нечіткого методу опису невизначеності. Формалізоване подання функції нечіткої множини. Графічне зображення функції належності нечіткого числа. Принципова відмінність теорії нечіткої множини від теорії ймовірностей. Основний зміст інтервального методу опису невизначеності. Переваги та недоліки інтервального методу.

Тема 7. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності

7.1. Значущість критеріїв у процесі прийняття оптимальних рішень в умовах невизначеності.

Принципи застосування критеріїв у процесі прийняття оптимальних рішень в умовах невизначеності.

7.2. Сутність критеріїв оптимальності в умовах невизначеності.

Критерій гарантованого результату (Вальда). Критерій оптимізму. Критерій Севіджа. Узагальнений критерій Гурвіца. Критерій песимізму. Критерій Лапласа.

Змістовий модуль 2.

Прийняття господарських рішень в умовах ризику

Тема 8. Теорія корисності та її застосування у процесах прийняття рішень

8.1. Основні елементи теорії корисності.

Сутність поняття "корисність". Загальна та гранична корисність. Принципи спадної граничної корисності. Ординальна та кардинальна міри корисності. Визначення функції корисності. Аксиоми корисності.

8.2. Корисність за Нейманом – Моргенштерном.

Сутність поняття "лотерея". Головна теорема корисності. Оцінювання схильності/несхильності та байдужості особи, що приймає рішення, до ризику. Детермінований еквівалент корисності. Основні властивості функції корисності. Страхова сума. Премія за ризик. Основні варіанти поведінки особи, що приймає рішення.

8.3. Типові функції корисності. Етапи побудови функції корисності.

Основні характеристики функції корисності. Зростаючі функції корисності з несхильністю до ризику. Зростаючі функції корисності зі схильністю до ризику. Зростаюча функція корисності, яка характеризує байдужість до ризику. Основні етапи побудови функції корисності.

Тема 9. Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття господарських рішень

9.1. Сутнісна характеристика ризику.

Основні підходи до тлумачення поняття "ризик". Суб'єктивно-об'єктивна природа ризику. Положення суб'єктивної теорії ризику. Об'єкт та суб'єкт ризику. Зовнішні та внутрішні джерела ризику.

9.2. Ризик як економічна категорія.

Принципові ознаки ризику як економічної категорії. Основна мета теорії ризику. Сутність підприємницького ризику. Система постулатів підприємницького ризику.

9.3. Причини виникнення ризику. Функції ризику.

Зовнішні чинники виникнення ризику: фактори прямого та непрямого впливу. Внутрішні чинники виникнення ризику. Конструктивний та деструктивний характер регулятивної функції ризику. Історично-генетичний та соціально-правовий аспекти захисної функції ризику. Характерні властивості ризику.

9.4. Класифікація підприємницьких ризиків.

Види ризиків: за сферою виникнення (зовнішні та внутрішні); за тривалістю (короткострокові та постійні); за ступенем правомірності (виправдані, тобто правомірні, і не виправдані, тобто неправомірні); за часом виникнення (ретроспективні, поточні й перспективні); за факторами виникнення (політичні, економічні); за характером обліку (зовнішні, внутрішні); за характером наслідків (чисті, спекулятивні); за сферою підприємницької діяльності (виробничі, комерційні, фінансові, інвестиційні, страхові); пов'язані з виробничою діяльністю (організаційні, ринкові, кредитні, юридичні, техніко-виробничі).

Тема 10. Критерії прийняття господарських рішень за умов ризику

10.1. Сутність критеріїв прийняття господарських рішень за умов ризику.

Урахування ризику під час формування критеріїв прийняття рішень. Загальні процедури розрахунку критеріїв прийняття підприємницьких ризиків. Правило Байєса. Принцип Бернуллі. Критерій очікуваного значення. Критерій "очікуване значення – дисперсія". Критерій граничного рівня.

10.2. Метод дерева рішень.

Сутність методу дерева рішень. Елементи дерева рішень. Основні етапи обґрунтування та прийняття рішення за допомогою побудови дерева рішень.

Тема 11. Прийняття рішень у конфліктних ситуаціях

11.1. Сутнісна характеристика конфлікту.

Визначення поняття "конфлікт". Класифікація конфліктів. Причини виникнення конфліктів. Процес виникнення, розгортання конфлікту та управління конфліктною ситуацією. Основні методи подолання конфлікту. Наслідки конфлікту.

11.2. Формалізація конфліктних ситуацій.

Сутність поняття "конфліктна ситуація". Головне призначення та основні завдання теорії гри у процесі прийняття господарських рішень у конфліктних ситуаціях. Основні поняття теорії гри. Визначення платіжної матриці гри. Верхня та нижня ціни гри. Принцип мінімаксу.

11.3. Методи знаходження оптимальних стратегій.

Сідлова точка гри. Чисті та змішані стратегії гри. Умови застосування змішаних стратегій. Активні стратегії гравців. Графічний пошук оптимальної стратегії. Аналітичне знаходження оптимальної стратегії.

Тема 12. Обґрунтування фінансових та інвестиційних рішень за умов ризику

12.1. Інвестиційні рішення та критерій ефективності їх прийняття.

Критерії обґрунтування рішень під час прийняття (вибору) інвестиційного проекту. Урахування ризику в процесі обґрунтування ставки дисконтування. Коефіцієнт систематичного ризику. Опціональний критерій прийняття рішень. Систематичний ризик і очікувана дохідність компанії.

12.2. Сутність фінансових рішень.

Портфелі Г. Марковіца і Р. Гобіна. Теорія оптимального портфеля. Формування оптимального портфеля з обмеженої кількості цінних паперів. Оптимізація структури портфеля цінних паперів та оцінка ризику.

Тема 13. Якісне оцінювання підприємницьких ризиків

13.1. Сутність якісного оцінювання підприємницьких ризиків.

Мета та зміст якісного оцінювання ризиків. Принципи якісного оцінювання підприємницьких ризиків.

13.2. Методи якісного оцінювання ризику.

Процедура якісного оцінювання ризику. Загальна характеристика методів якісного оцінювання ризику.

Тема 14. Кількісне оцінювання підприємницьких ризиків

14.1. Методи кількісного аналізу.

Головне призначення кількісної оцінки ризику. Принципові положення кількісної оцінки ризику. Основні методи кількісної оцінки ризику. Порівняльна характеристика методів кількісної оцінки ризику.

14.2. Загальні процедури кількісного оцінювання ризику.

Експертні методи оцінки ризику. Статистичний метод вимірювання ризику. Зміст аналітичного методу оцінки ризику. Метод аналогій.

Тема 15. Основи ризик-менеджменту

15.1. Сутність ризик-менеджменту.

Головний зміст ризик-менеджменту. Основні елементи системи ризик-менеджменту. Структурна схема ризик-менеджменту. Принципи ризик-менеджменту.

15.2. Функції ризик-менеджменту.

Функції об'єкта та суб'єкта управління. Прогнозування в ризик-менеджменті. Організація в ризик-менеджменті. Регулювання в ризик-менеджменті. Координація в ризик-менеджменті. Стимулювання в ризик-менеджменті. Контроль у ризик-менеджменті.

Тема 16. Напрями і методи регулювання та зниження ступеня ризику

16.1. Основні етапи управління ризиком.

Необхідність управління ризиками господарської діяльності. Етапи реалізації процесу управління ризиком. Методи одержання інформації про ризики. Система показників ризиків.

16.2. Методи регулювання та зниження ступеня ризику.

Основні напрями й методи впливу на ступінь ризику господарювання. Уникнення та компенсація ризику. Збереження та передавання ризику. Хеджування та страхування ризиків. Методи зниження ступеня ризику. Характеристика диверсифікації діяльності підприємства. Модель "імовірність виникнення втрат/рівень збитків" для пошуку рішення щодо оптимізації ступеня ризику.

4. Структура навчальної дисципліни

Із самого початку вивчення навчальної дисципліни кожен студент має бути ознайомлений як з робочою програмою навчальної дисципліни і формами організації навчання, так і зі структурою, змістом та обсягом кожного з її навчальних модулів, а також з усіма видами контролю та методикою оцінювання сформованих професійних компетентностей.

Вивчення студентом навчальної дисципліни відбувається шляхом послідовного і ґрунтовного опрацювання навчальних модулів. Навчальний модуль – це окремий, відносно самостійний блок дисципліни, який логічно об'єднує кілька навчальних елементів дисципліни за змістом та взаємозв'язками. Тематичний план дисципліни складається з двох змістових модулів (табл. 4.1).

Структура залікового кредиту навчальної дисципліни

Назви змістових модулів і тем	Кількість годин													
	денна форма							заочна форма						
	усього	у тому числі						усього	у тому числі					
		лекційні	практичні	лабораторні	проведення підсумкового контролю виконання	самостійна робота			лекційні	практичні	лабораторні	проведення підсумкового контролю виконання	самостійна робота	
2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	
Змістовий модуль 1.														
Теоретичні та методологічні засади прийняття господарських рішень														
<i>Тема 1.</i> Сутнісна характеристика господарських рішень	9	2	2	–	–	–	5	9	2	1	–	–	–	6
<i>Тема 2.</i> Технологія прийняття рішень господарської діяльності	9	2	2	–	–	–	5	9	2	1	–	–	–	6
<i>Тема 3.</i> Методичні основи підготовки господарських рішень	21	4	4	–	–	–	13	12	2	2	–	–	–	8
<i>Тема 4.</i> Обґрунтування господарських рішень та оцінювання їх ефективності	10	2	2	–	–	–	6	9	2	1	–	–	–	6
<i>Тема 5.</i> Прогнозування та аналіз господарських рішень	10	2	–	2	–	–	6	12	2	2	–	–	–	8
<i>Тема 6.</i> Невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності	10	2	2	–	–	–	6	8	1	1	–	–	–	6

Продовження табл. 4.1

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15
<i>Тема 7. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності</i>	11	2	2	–	–	–	7	8	1	1	–	–	–	6
Разом за змістовим модулем 1	80	16	14	2	–	–	48	67	12	9	–	–	–	46
Змістовий модуль 2.														
Прийняття господарських рішень в умовах ризику														
<i>Тема 8. Теорія корисності та її застосування у процесах прийняття рішень</i>	9	2	2	–	–	2	3	12	2	1	–	–	2	7
<i>Тема 9. Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття господарських рішень</i>	9	2	2	–	–	2	3	10	2	1	–	–	2	7
<i>Тема 10. Критерії прийняття господарських рішень за умов ризику</i>	9	2	2	–	–	2	3	11	1	1	–	–	2	6
<i>Тема 11. Прийняття рішень у конфліктних ситуаціях</i>	10	2	2	–	–	2	4	11	2	1	–	–	2	6
<i>Тема 12. Обґрунтування фінансових та інвестиційних рішень за умов ризику</i>	9	2	2	–	–	2	3	12	1	1	–	–	2	7
<i>Тема 13. Якісне оцінювання підприємницьких ризиків</i>	10	2	2	–	–	2	4	11	2	1	–	–	2	6
<i>Тема 14. Кількісне оцінювання підприємницьких ризиків</i>	11	2	2	–	–	2	5	12	2	1	–	–	2	7
<i>Тема 15. Основи ризик-менеджменту</i>	9	2	–	2	–	2	3	10	1	1	–	–	2	6

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15
Тема 16. Напрями і методи регулювання та зниження ступеня ризику	10	2	2	–	–	2	4	10	1	1	–	–	2	6
Разом за змістовим модулем 2	86	18	16	2	–	18	32	99	14	9	–	–	18	58
Підготовка до екзамену	10	–	–	–	–	–	10	10	–	–	–	–	–	10
Передекзаменаційні консультації	2	–	–	–	2	–	–	2	–	–	–	2	–	–
Екзамен	2	–	–	–	2	–	–	2	–	–	–	2	–	–
Усього годин за модулем	180	34	30	4	4	108	180	26	18	–	4	132		

5. Теми та плани семінарських занять

Семінарське заняття – форма навчального заняття, за якої викладач організовує дискусію навколо попередньо визначених тем, до яких студенти готують тези виступів. На кожному семінарському занятті викладач оцінює підготовлені студентами доповіді та презентації з окреслених питань (табл. 5.1), їх виступи, активність у дискусії, вміння формулювати і відстоювати свою позицію тощо. Підсумкові бали за кожне семінарське заняття виставляються у відповідний журнал. Отримані студентом бали за окремі семінарські заняття враховуються в процесі накопичення підсумкових балів з даної навчальної дисципліни.

Таблиця 5.1

Плани семінарських занять

Назва теми	Програмні питання	Кількість годин	Література
1	2	3	4
Змістовий модуль 1.			
Теоретичні та методологічні засади прийняття господарських рішень			
Тема 1. Сутнісна характеристика господарських рішень	<p style="text-align: center;"><i>Тема семінарського заняття</i> <i>"Особливості розвитку теорії про господарські рішення: історичний та сучасний аспекти":</i></p> <p>1. Генезис науки про управлінські рішення та її зв'язок з іншими науками. 2. Особливості сучасного розвитку теорії про господарські рішення</p>	2	<p>Основна: [1 – 3]. Додаткова: [4; 8; 9; 11; 12; 16; 17; 22; 33 – 36]</p>

1	2	3	4
	<p>3. Основні відмінності управлінських рішень від інших рішень.</p> <p>4. Роль господарських рішень у підвищенні ефективності функціонування суб'єктів економічної діяльності. Напрями підвищення ефективності господарських рішень.</p> <p>5. Специфіка проблем прийняття господарських рішень на підприємствах України</p>		
Тема 6. Невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності	<p><i>Тема семінарського заняття</i> <i>"Невизначеність – фундаментальна характеристика економічних процесів":</i></p> <p>1. Сучасні підходи до визначення природи невизначеності.</p> <p>2. Види невизначеності. Аналіз чинників невизначеності.</p> <p>3. Взаємозв'язок невизначеності та ризику.</p> <p>4. Математичні методи формалізації невизначеної інформації.</p> <p>5. Ризик як методологія подолання невизначеності</p>	2	<p>Основна: [1 – 3].</p> <p>Додаткова: [7; 11; 12; 18; 27; 28]</p>
Усього годин		4	

6. Теми практичних занять

Практичне заняття – форма навчального заняття, за якої викладач організовує детальний розгляд окремих теоретичних положень навчальної дисципліни і формує вміння та навички їх практичного застосування шляхом індивідуального виконання студентом сформульованих завдань. Проведення таких занять ґрунтується на попередньо підготовленому методичному матеріалі – тестах для виявлення ступеня оволодіння необхідними теоретичними положеннями, наборі завдань різного рівня складності для розв'язування їх на занятті. Воно включає проведення попереднього контролю знань, вмінь і навичок студентів, постановку загальної проблеми викладачем та її обговорення за участю студентів, розв'язування завдань із їх обговоренням, розв'язування контрольних завдань, їх перевірку, оцінювання (табл. 6.1).

Перелік тем практичних занять

Назва змістового модуля	Теми практичних занять (за модулями)	Кількість годин	Література
1	2	3	4
<i>Змістовий модуль 1.</i> Теоретичні та методологічні засади прийняття господарських рішень	<i>Завдання 1.</i> Прийняття господарських рішень з використанням методу аналізу ієрархії	2	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [4; 8; 9; 11; 12; 16; 17; 22; 35; 36]
	<i>Завдання 2.</i> Планування випуску продукції за допомогою графічного методу та симплекс-методу лінійного програмування. <i>Завдання 3.</i> Вибір оптимального плану перевезень продукції	4	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [4; 8; 9; 11; 12; 16; 17; 22; 35; 36]
	<i>Завдання 4.</i> Вибір інвестиційного проекту за допомогою методу максимінної згортки	2	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [4; 8; 9; 11; 12; 16; 17; 22; 35; 36]
	<i>Колоквіум</i> за змістовим модулем 1 "Теоретичні та методологічні засади прийняття господарських рішень"	2	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [4; 8; 9; 11; 12; 16; 17; 22; 35; 36]
<i>Змістовий модуль 2.</i> Прийняття господарських рішень в умовах ризику	<i>Завдання 6.</i> Оцінка схильності ОПР до ризику з використанням теорії корисності	2	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [5 – 7; 10; 13 – 15; 18; 19; 20; 23 – 26]

1	2	3	4
	<i>Завдання 7.</i> Вибір оптимального інноваційного проекту на основі дерева рішень	2	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [5 – 7; 10; 13 – 15; 18; 19; 20; 23 – 26]
	<i>Завдання 8.</i> Обґрунтування господарських рішень в умовах ризику (критерії Байєса, Ходжена – Лемана)	2	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [5 – 7; 10; 13 – 15; 18; 19; 20; 23 – 26]
	<i>Завдання 9.</i> Вибір оптимальної стратегії в умовах конфлікту	2	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [8 – 10; 12 – 14; 18; 21 – 25; 27; 28; 31; 33; 35; 36]
	<i>Завдання 10.</i> Оцінка ризику портфеля цінних паперів. <i>Завдання 11.</i> Оцінка ризику інвестиційних проектів	2	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [5 – 7; 10; 13 – 15; 18 – 26; 35; 36]
	<i>Завдання 12.</i> Експертна оцінка рівня ризику діяльності підприємства	2	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [5 – 7; 10; 13 – 15; 18 – 26; 35; 36]
	<i>Завдання 13.</i> Статистичний та аналітичний методи кількісної оцінки ризиків	2	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [5 – 7; 10; 13 – 15; 18 – 26; 35; 36]

1	2	3	4
	Колоквіум за змістовим модулем 2 "Прийняття господарських рішень в умовах ризику"	2	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [5 – 7; 10; 12 – 15; 17 – 19; 23 – 37]
Разом годин за змістовими модулями		26	

6.1. Приклади типових практичних завдань за темами

Змістовий модуль 1.

Теоретичні та методологічні засади прийняття господарських рішень

Тема 3. Методичні основи підготовки господарських рішень

Рівень 1. Фабрика виробляє два види фарб: перший – для зовнішніх, а другий – для внутрішніх робіт. Для виробництва фарб використовуються два інгредієнти: А і В. Максимально можливі добові запаси цих інгредієнтів становлять 6 і 8 т відповідно. Відомі витрати А і В на 1 т відповідних фарб (табл. 6.2). Вивчення ринку збуту показало, що добовий попит на фарбу 2-го виду ніколи не перевищує попиту на фарбу 1-го виду більше, ніж на 1 т. Крім того, встановлено, що попит на фарбу 2-го виду ніколи не перевищує 2 т на добу. Оптові ціни однієї тонни фарби: 3 тис. грн – для фарби 1-го виду; 2 тис. грн – для фарби 2-го виду.

Таблиця 6.2

Вихідні дані

Інгредієнти	Витрати інгредієнтів, т інгр./т фарби		Запас, т інгр./добу
	Фарба 1-го виду	Фарба 2-го виду	
А	1	2	6
В	2	1	8

Необхідно побудувати цільову функцію та систему обмежень до неї.

Рівень 2. Використовуючи вихідні дані попереднього завдання, розрахуйте оптимальний план випуску продукції графічним методом.

Рівень 3. Використовуючи вихідні дані попереднього завдання, розрахуйте оптимальний план випуску продукції симплекс-методом.

Змістовий модуль 2.

Прийняття господарських рішень в умовах ризику

Тема 8. Теорія корисності та її застосування у процесах прийняття рішень

Рівень 1. Є два результати. Можна розглянути дві прості лотереї $L_1 = (0,2; 0,8)$ та $L_2 = (0,3; 0,7)$ і складену лотерею $(L_1 0,4; L_2 0,6)$:

$$f(x) = \begin{cases} 0, & x < 5; \\ \frac{1}{15}, & 5 \leq x \leq 20; \\ 0, & x > 20. \end{cases}$$

Якій простій лотереї еквівалентна складена?

Рівень 2. Лотерею задано з рівномірною щільністю розподілу.

Функція корисності має вигляд $U(x) = -e^{-0.1x}$. Обчисліть очікуваний вигравш, детермінований еквівалент та премію за ризик. Вкажіть тип ставлення до ризику за даною функцією корисності.

Рівень 3. Нехай особа має функцію корисності $U(X)$. Ця особа вивчає для себе можливість участі в одній із лотерей $L_1(25; 0,6; 45)$ та $L_2(35; 0,2; 45)$. Якій із цих лотерей ОПР надасть перевагу, якщо функція корисності цієї особи задається наступним чином:

1) $U(X) = 0,15x^2$;

2) $U(X) = \sqrt{x}$;

3) $U(X) = 15 + 3x$?

Як ця особа ставиться до ризику в кожному з випадків?

Тема 14. Кількісне оцінювання підприємницьких ризиків

Рівень 1. Надаючи банківський кредит двом комерційним фірмам, банк розраховує, що для першої фірми збитки можливі у 20 % випадків при сумі збитків 20 000 ум. од., а для іншої – у 25 % при сумі збитку 18 000 ум. од. Якій фірмі надати кредит?

Рівень 2. Необхідно надати рекомендації щодо можливого періоду надання кредиту оптовим покупцям за наступними даними. Запланований валовий дохід від реалізації продукції з наданням товарного кредиту – 600 тис. грн. Розрахункові повні витрати на 1 грн реалізації – 0,75 грн. Середній період затримки платежів на підприємствах за наданими креди-

тами – 20 днів. Період надання кредиту оптовим покупцям – 350 днів. До того ж, необхідно врахувати ліміт за максимальною величиною дебіторської заборгованості (20 % від обсягу реалізації).

Рівень 3. Розрахуйте якісні показники ризику. Вихідні дані про вкладення капіталу в проекти А, Б наведені в табл. 6.3.

Таблиця 6.3

Вихідні дані

№ події	Отриманий прибуток, тис. ум. од. (x)	Кількість випадків спостережень (f)
Проект А		
1	25	48
2	20	36
3	30	36
Проект Б		
1	40	30
2	30	50
3	15	20

На користь якого проекту можна зробити вибір про величину вкладення капіталу?

7. Теми лабораторних занять

Лабораторне заняття – форма навчального заняття, за якої студент під керівництвом викладача особисто проводить імітаційні експерименти чи досліді з метою практичного підтвердження окремих теоретичних положень навчальної дисципліни. У ході лабораторних робіт студент набуває професійних компетенцій та практичних навичок роботи з комп'ютерним обладнанням відповідними програмними продуктами. За результатами виконання завдання на лабораторному занятті студенти оформляють індивідуальні звіти про його виконання та захищають ці звіти перед викладачем (табл. 7.1).

Перелік тем лабораторних занять

Назва теми	Програмні питання	Кількість годин	Література
Змістовий модуль 1.			
Теоретичні та методологічні засади прийняття господарських рішень			
Тема 5. Прогнозування та аналіз господарських рішень	Завдання 5. Прийняття рішень на основі прогнозування результатів діяльності підприємства	2	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [8; 9; 21; 27; 28; 35]
Змістовий модуль 2.			
Прийняття господарських рішень в умовах ризику			
Тема 15. Основи ризик-менеджменту	Завдання 14. Комплексне оцінювання ризиків підприємства з використанням методів теорії нечітких множин	2	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [8; 9; 13; 14; 18; 21; 27; 28]
Усього годин		4	

8. Самостійна робота

Самостійна робота студента (СРС) – це форма організації навчального процесу, за якої заплановані завдання виконуються студентом самостійно під методичним керівництвом викладача.

Мета СРС – засвоєння в повному обсязі навчальної програми та формування у студентів загальних і професійних компетентностей, які відіграють суттєву роль у становленні майбутнього фахівця вищого рівня кваліфікації.

Навчальний час, відведений для самостійної роботи студентів денної форми навчання, визначається навчальним планом і становить 67 % (108 годин) від загального обсягу навчального часу на вивчення дисципліни (180 годин). У ході самостійної роботи студент має перетворитися на активного учасника навчального процесу, навчитися свідомо ставитися до оволодіння теоретичними і практичними знаннями, вільно орієнтуватися в інформаційному просторі, нести індивідуальну відповідальність за якість власної професійної підготовки. СРС включає: опрацювання лекційного матеріалу; опрацювання та вивчення рекомендованої літератури,

основних термінів та понять за темами дисципліни; підготовку до практичних, семінарських, лабораторних занять; підготовку до виступу на семінарських заняттях; поглиблене опрацювання окремих лекційних тем або питань; виконання індивідуальних завдань (вирішення розрахункових індивідуальних та комплексних завдань) за вивченою темою; написання есе за заданою проблематикою; пошук (підбір) та огляд літературних джерел за заданою проблематикою дисципліни; аналітичний розгляд наукової публікації; контрольну перевірку студентами особистих знань за запитаннями для самодіагностики; підготовку до контрольних робіт та інших форм поточного контролю; підготовку до модульного контролю (колоквіуму); систематизацію вивченого матеріалу з метою підготовки до семестрового екзамену.

Необхідним елементом успішного засвоєння матеріалу навчальної дисципліни є самостійна робота студентів з вітчизняною та закордонною спеціальною економічною літературою, нормативними актами з питань державного регулювання економіки, статистичними матеріалами. Основні види самостійної роботи, які запропоновані студентам для засвоєння теоретичних знань з навчальної дисципліни, наведені в табл. 8.1.

Таблиця 8.1

Завдання для самостійної роботи студентів та форми її контролю

Назва теми	Зміст самостійної роботи студентів	Кількість годин	Форми контролю СРС	Література
1	2	3	4	5
Змістовий модуль 1.				
Теоретичні та методологічні засади прийняття господарських рішень				
<i>Тема 1. Сутнісна характеристика господарських рішень</i>	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до <i>семінарського заняття</i> , огляд теоретичного матеріалу з теми "Особливості розвитку теорії про господарські рішення: історичний та сучасний аспекти"	5	Презентація результатів	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [4; 8; 9; 11; 12; 16; 17; 22; 33 – 35]

1	2	3	4	5
<i>Тема 2.</i> Технологія прийняття рішень господарської діяльності	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до практичного заняття. Підготовка до контрольної роботи за темами 1 і 2. Виконання <i>індивідуального завдання</i> "Прийняття господарських рішень з використанням методу аналізу ієрархії"	5	Захист індивідуального завдання	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [4; 8; 9; 11; 12; 16; 17; 22; 35; 36]
<i>Тема 3.</i> Методичні основи підготовки господарських рішень	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до практичного заняття, підготовка до контрольної роботи. Виконання <i>індивідуальних завдань</i> "Планування випуску продукції за допомогою графічного методу та симплекс-методу лінійного програмування", "Вибір оптимального плану перевезень продукції"	13	Письмова контрольна робота за темами 1 і 2. Захист індивідуального завдання	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [4; 8; 9; 11; 12; 16; 17; 22; 35; 36]
<i>Тема 4.</i> Обґрунтування господарських рішень та оцінювання їх ефективності	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою; виконання <i>індивідуального завдання</i> "Вибір інвестиційного проекту за допомогою методу максимінної згортки"	6	Захист індивідуального завдання	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [4; 8; 9; 11; 12; 16; 17; 22; 35; 36]
<i>Тема 5.</i> Прогнозування та аналіз господарських рішень	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до практичного заняття. Виконання <i>індивідуального завдання</i> "Прогнозування результатів діяльності підприємства на основі декомпозиції часового ряду"	6	Захист індивідуального завдання	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [8; 9; 21; 27; 28; 35]

1	2	3	4	5
Тема 6. Невизначеність як першо-причина ризику підприємницької діяльності	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою; підготовка до практичного заняття, підготовка до <i>тестування</i> . Підготовка до <i>семінарського заняття</i> з теми "Невизначеність – фундаментальна характеристика економічних процесів"	6	Презентація результатів	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [7; 11; 12; 18; 27; 28]
Тема 7. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до практичного заняття, підготовка до <i>колоквіуму</i> . Виконання <i>індивідуального завдання</i> "Обґрунтування господарських рішень в умовах невизначеності та ризику (критерії Лапласа, Вальда, Севіджа, Гурвіца, оптимізму, песимізму, критерії Байєса, Ходжена – Лемана, принцип Бернуллі)", підготовка до <i>колоквіуму</i>	7	Захист індивідуального завдання	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [5 – 7; 10; 13 – 15; 18; 19; 20; 23 – 26]
Усього за змістовим модулем 1		48		
Змістовий модуль 2.				
Прийняття господарських рішень в умовах ризику				
Тема 8. Теорія корисності та її застосування у процесах прийняття рішень	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою. Виконання <i>індивідуального завдання</i> "Побудова функції корисності ОПР", виконання <i>індивідуального науково-дослідного завдання</i> (ІНДЗ) "Формування ефективних господарських рішень на підприємстві з урахуванням ризику"	5	Захист індивідуального завдання	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [5 – 7; 10; 13 – 15; 18; 19; 20; 23 – 26]

Продовження табл. 8.1

1	2	3	4	5
<i>Тема 9.</i> Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття господарських рішень	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до практичного заняття. <i>Есе</i> на тему "Збутові ризики та причини їх виникнення", виконання ІНДЗ	5	Перевірка есе	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [8 – 10; 12 – 14, 18; 21 – 25; 28; 33; 35; 36]
<i>Тема 10.</i> Критерії прийняття господарських рішень за умов ризику	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою; написання есе на тему "Порівняльна характеристика критеріїв прийняття рішень в умовах ризику", виконання ІНДЗ	5	Перевірка есе	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [5 – 7; 13 – 15; 18 – 26]
<i>Тема 11.</i> Прийняття рішень у конфліктних ситуаціях	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою. <i>Самостійне опрацювання лекційного матеріалу:</i> 1. Теорія кінцевих антагоністичних ігор. 2. Модель торгів. 3. Графоаналітичний спосіб пошуку оптимального рішення за конфліктної ситуації. Виконання ІНДЗ	6	Експрес-опитування	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [5 – 7; 10; 13 – 15; 18 – 26; 35; 36]
<i>Тема 12.</i> Обґрунтування фінансових та інвестиційних рішень за умов ризику	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою. Виконання <i>індивідуального завдання</i> "Оцінка ризику інвестиційних проектів", виконання ІНДЗ	5	Захист індивідуального завдання	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [5 – 7; 10; 13 – 15; 18 – 26; 35; 36]
<i>Тема 13.</i> Якісне оцінювання підприємницьких ризиків	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до практичного заняття. Виконання <i>індивідуального завдання</i> "Експертна оцінка рівня ризику діяльності підприємства", виконання ІНДЗ	6	Захист індивідуального завдання	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [5 – 7; 10; 13 – 15; 18 – 26; 35; 36]

Закінчення табл. 8.1

1	2	3	4	5
<i>Тема 14. Кількісне оцінювання підприємницьких ризиків</i>	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до практичного заняття. Виконання <i>індивідуального завдання</i> "Статистичний та аналітичний методи кількісної оцінки ризиків", виконання ІНДЗ	7	Захист індивідуального завдання	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [5 – 7; 10; 13 – 15; 18 – 26; 35; 36]
<i>Тема 15. Основи ризик-менеджменту</i>	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою. <i>Самостійне опрацювання лекційного матеріалу:</i> 1. Формування комплексної системи ризик-менеджменту на підприємствах. 2. Оцінювання ефективності системи ризик-менеджменту. Підготовка до колоквиуму. Виконання ІНДЗ	5	Експрес-опитування	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [8; 9; 13; 14; 18; 21; 27; 28]
<i>Тема 16. Напрями і методи регулювання та зниження ступеня ризику</i>	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до практичного заняття, підготовка до <i>колоквиуму</i> . Підготовка презентації ІНДЗ	6	Захист ІНДЗ	Основна: [1 – 3]. Додаткова: [5 – 7; 10; 12 – 14; 15; 17 – 19; 23 – 37]
Усього за змістовим модулем 2		50		
<i>Підготовка до екзамену</i>		10		Основна: [1 – 3]. Додаткова: [5 – 7; 10; 12 – 15; 17 – 19; 23 – 37]
<i>Екзамен</i>		2		
Усього за модулем		108		

8.1. Індивідуальне науково-дослідне завдання

Індивідуальне науково-дослідне завдання (ІНДЗ) студента є вибірконим видом позааудиторної самостійної роботи студента та має навчально-дослідницький характер, виконується у процесі вивчення програмного матеріалу навчальної дисципліни і завершується разом зі складанням підсумкового екзамену з даної навчальної дисципліни. Виконання ІНДЗ є одним із важливих засобів підвищення якості підготовки майбутніх спеціалістів, які здатні застосовувати на практиці теоретичні знання, вміння та навички з даної навчальної дисципліни.

Підготовка ІНДЗ передбачає систематизацію, закріплення, розширення теоретичних і практичних знань із дисципліни та застосування їх у процесі розв'язання конкретних економічних ситуацій, розвиток навичок самостійної роботи й оволодіння методикою дослідження та експерименту, пов'язаних із темою ІНДЗ.

ІНДЗ передбачає наявність наступних елементів наукового дослідження: практичної значущості, комплексного системного підходу до вирішення завдань дослідження, теоретичного використання передової сучасної методології та наукових розробок, наявність елементів творчості, вміння застосовувати сучасні технології.

Практична значущість ІНДЗ полягає в обґрунтуванні реальності його результатів для потреб практики.

Реальною вважається робота, яка виконана відповідно до наявних проблем підприємства, на основі його реальних даних за кілька років і результати якої повністю або частково можуть бути впроваджені в практику діяльності підприємства.

Комплексний системний підхід до розкриття теми роботи полягає в тому, що предмет дослідження розглядається з різних точок зору – з позицій теоретичної бази і практичних напрацювань, умов його реалізації на підприємстві, аналізу, обґрунтування шляхів удосконалення тощо – в тісному взаємозв'язку та єдиній логіці викладу.

Застосування сучасної методології полягає в тому, що в процесі виконання аналізу стратегічних позицій підприємства й обґрунтування шляхів удосконалення окремих аспектів предмета та об'єкта дослідження студент повинен використовувати відомості про новітні досягнення в техніці і технологіях дослідження, застосовувати різноманітні методи й засоби діагностичних досліджень, підходи до визначення та обґрунтування вибору критеріїв і показників експрес-діагностування виробничо-економічної системи або її елементів.

У процесі виконання ІНДЗ разом з теоретичними знаннями і практичними навичками за фахом студент повинен продемонструвати здатність до науково-дослідної роботи та вміння творчо мислити.

Тема ІНДЗ: *"Формування ефективних господарських рішень на підприємстві з урахуванням ризику"*.

Мета ІНДЗ – формування практичних навичок та вміння їх застосувати в процесі вирішення поставленого завдання.

Об'єктом ІНДЗ є процеси господарської діяльності підприємства відповідно до обраної студентом бази практики.

Предмет ІНДЗ – сукупність теоретико-методичних підходів до формування ефективних господарських рішень на підприємстві з урахуванням ризику.

Індивідуальне науково-дослідне завдання виконується студентом самостійно за консультування з викладачем протягом вивчення дисципліни відповідно до графіка навчального процесу.

Індивідуальне науково-дослідне завдання видається викладачем на початку семестру, протягом якого вивчається дисципліна. Студент має надати ІНДЗ для перевірки наприкінці семестру, але не пізніше терміну проведення підсумкового модульного контролю. Бали за виконання ІНДЗ враховуються під час виставлення загальної оцінки з дисципліни.

Вимоги до оформлення. Формат аркуша – А4. Поля: ліве – 30 мм; праве, верхнє та нижнє – 20 мм. Шрифт Arial, розмір шрифту для основного тексту – кг 14. Міжрядковий інтервал – множник 1,3. Не дозволяються виділення в тексті курсивом та підкреслення.

Обсяг ІНДЗ повинен становити у друкованому варіанті 30 – 40 сторінок.

Кожен розділ розпочинають з нової сторінки. Назви розділів оформляються великими літерами по центру сторінки. Сторінки нумеруються у правому верхньому куті. На титульному аркуші номер сторінки не ставиться.

Вимоги до змісту. Індивідуальне науково-дослідне завдання повинне складатися з таких елементів, як:

- титульна сторінка;
- зміст;
- вступ (1,5 сторінки);
- основна частина (27 – 37 сторінок);
- висновок (1,5 сторінки);
- список використаної літератури;
- додатки (за необхідності).

Вступ повинен відображати наступні елементи: актуальність теми, проблемне поле теми, мету дослідження, об'єкт, предмет, завдання, базу та методи дослідження.

В **основній частині роботи** (може містити декілька підрозділів) студенти повинні:

надати аналітичну оцінку зовнішнього середовища та визначити його чинники, які мають найбільший вплив на господарську діяльність підприємства;

ідентифікувати основні ризики підприємства та визначити рівень значущості кожного з них;

провести оцінку внутрішнього середовища підприємства та сформуванати систему показників-дестимуляторів, які погіршують господарську діяльність підприємства;

розробити заходи щодо формування ефективних рішень господарської діяльності підприємства з урахуванням ризику.

Висновки повинні містити обґрунтовані та змістові, практичні рекомендації щодо формування ефективних господарських рішень підприємства в умовах ризику.

Список використаної літератури слід розміщувати в алфавітному порядку прізвищ перших авторів або заголовків. Бібліографічний опис джерел складають відповідно до ДСТУ ГОСТ 7.1:2006 "Бібліографічний запис, бібліографічний опис. Загальні вимоги та правила складання".

Додатки можуть бути включені за необхідності. У разі наявності кількох додатків оформляється окрема сторінка "ДОДАТКИ", номер якої є останнім, що включається до обсягу ІНДЗ. Кожен додаток починають із нової сторінки. Відповідно до вимог, додаток називають у такий спосіб: "Додаток А", "Додаток Б" і т. д. за алфавітом, за винятком букв Г, Ґ, Є, І, Ї, Й, О, Ч, Ь, при цьому написи "Додаток...", "Продовження додатка..." та "Закінчення додатка..." пишуться малими літерами з першої великої і вирівнюються по правому краю сторінки. Допускається розподіл додатків на розділи типу "Додаток А.3". Ілюстрації, таблиці, формули нумерують відповідно до назви додатка, наприклад "рис. А.3".

8.2. Контрольні запитання для самодіагностики

Тема 1. Сутнісна характеристика господарських рішень

1. Визначте сутність господарських рішень та їх місце в процесі управління на рівні підприємства.

4. Хто є суб'єктом управління та прийняття господарських рішень?
5. Охарактеризуйте учасників розробки та прийняття господарських рішень.
6. Визначте та охарактеризуйте види господарських рішень за різними класифікаційними ознаками.
7. Які існують вимоги до господарських рішень та умови їх досягнення?
8. Охарактеризуйте основні форми вираження та реалізації господарських рішень.
9. Які показники якості прийняття господарських рішень вам відомі?
10. Охарактеризуйте процес управління та прийняття господарських рішень.
11. Назвіть чинники якості господарських рішень.
12. Що означає ефективність господарського рішення? Охарактеризуйте види ефективності господарського рішення.
13. У чому полягає сутність принципу єдності в процесі оцінювання ефективності господарського рішення?
14. Які труднощі можуть виникнути в процесі оцінювання ефективності господарського рішення?

Тема 2. Технологія прийняття рішень господарської діяльності

1. Визначте поняття "процес прийняття господарських рішень".
2. Охарактеризуйте етапи підготовки, розробки й реалізації господарських рішень.
3. Охарактеризуйте статистичні та динамічні завдання прийняття рішень.
4. Які стадії прийняття рішень вам відомі?
5. У чому полягає сутність процесу дивергенції?
6. Охарактеризуйте основні елементи другої стадії прийняття рішень.
7. Які основні методи конвергенції вам відомі?
8. У чому сутність методу Ішікави?
9. Які існують способи формування пріоритетів?
10. Назвіть та охарактеризуйте види рішень, що засновані на судженнях.
11. Які умови прийняття рішень вам відомі? Охарактеризуйте їх.
12. Назвіть основні характеристики класичної, поведінкової, ірраціональної моделей прийняття рішень.

Тема 3. Методичні основи підготовки господарських рішень

1. Що означає поняття "метод"?
2. Розкрийте основний зміст методів математичного програмування.
3. Дайте визначення та характеристику кореляційному аналізу.
4. Наведіть аналітичну форму визначення коефіцієнта кореляції.
5. Дайте визначення та характеристику регресійному аналізу.
6. Наведіть загальний вигляд лінійної регресійної функції.
7. Розкрийте сутність методу факторного аналізу.
8. Розкрийте сутність кластерного аналізу.
9. Визначте сутність евристичних методів розробки господарських рішень.
10. Визначте і охарактеризуйте методи експертних оцінок у процесі підготовки господарських рішень.
11. Вкажіть основні види змінних у математичних моделях прийняття рішень.
12. Які види математичних моделей прийняття рішень вам відомі?

Тема 4. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання їх ефективності

1. Які критерії оцінки для вибору методу обґрунтування господарських рішень вам відомі?
2. Охарактеризуйте критерії оцінки в системі обґрунтування господарських рішень.
4. Перелічіть принципи обґрунтування господарських рішень.
3. У чому полягає сутність принципу правомірності обґрунтування господарських рішень?
4. Розкрийте зміст дескриптивного підходу до обґрунтування та вибору господарських рішень.
5. Які основні цілі оцінки ефективності прийнятих рішень?
6. Що означає абсолютна ефективність господарського рішення?
7. Які вимоги необхідно враховувати, оцінюючи ефективність функціонування системи управлінських рішень?
8. Якими показниками оцінюється система управлінських рішень?
9. Охарактеризуйте критерії оцінки ефективності господарських рішень.
10. Які методи оцінки ефективності господарських рішень вам відомі?
11. Наведіть класифікацію чинників, що впливають на ефективність прийняття рішення.

Тема 5. Прогнозування та аналіз господарських рішень

1. Яка мета та основні завдання прогнозування?
2. Охарактеризуйте процес прогнозування господарських рішень.
3. Які основні етапи прогнозування господарських рішень?
4. Що означає поняття "ретроспекція"?
5. Які принципи прогнозування господарських рішень вам відомі?
6. У чому полягає сутність принципів адекватності та верифікованості прогнозування господарських рішень?
8. Які основні функції прогнозування господарських рішень?
9. Які методи отримання інформації використовують для прогнозування господарських рішень?
10. Які методи прогнозування залежно від достовірності та наявної вихідної інформації вам відомі? Охарактеризуйте їх.
11. Наведіть класифікацію методів прогнозування господарських рішень.
12. Які методи складають групу формалізованих методів прогнозування господарських рішень?
13. У чому полягає сутність аналізу господарських рішень?
14. Які ключові принципи аналізу господарських рішень вам відомі?
15. Назвіть основні методи аналізу господарських рішень.

Тема 6. Невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності

1. Визначте поняття "невизначеність" як явище.
2. У чому полягає сутність невизначеності як процесу?
3. Що означає повна та часткова невизначеність?
4. Які джерела невизначеності?
5. Охарактеризуйте ієрархічну структуру невизначеності.
6. Які види невизначеності вам відомі залежно від рівня поінформованості особи, яка приймає рішення?
7. Наведіть класифікацію причин виникнення невизначеності.
8. Розкрийте сутність невизначеності зовнішнього середовища.
9. У чому полягає сутність імовірнісного методу опису невизначеності?
10. У чому полягає сутність методу нечітких множин опису невизначеності?
11. У чому полягає сутність інтервального методу опису невизначеності?

Тема 7. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності

1. Розкрийте основне призначення критеріїв прийняття рішень в умовах невизначеності.
2. Які критерії застосовуються в процесі прийняття рішень в умовах невизначеності?
3. Якими є особливості застосування критерію Лапласа та максимального (мінімаксного) критерію? Визначте їх.
4. У чому полягає сутність критерію гарантованого результату?
5. Якими є особливості застосування критерію Севіджа?
6. За яких умов може бути використаний критерій Гурвіца? Обґрунтуйте свій погляд.
7. Перелічіть основні недоліки критерію Гурвіца.
8. Напишіть формулу розрахунку критерію Лапласа.

Тема 8. Теорія корисності та її застосування у процесах прийняття рішень

1. Що означає поняття "корисність"?
2. Розкрийте зміст загальної та граничної корисності. Зобразіть їх графічно.
3. Поясніть математичні символи запису функції корисності.
4. У чому основний сенс аксіоми порівняльності?
5. У чому полягає сутність аксіоми транзитивності?
7. Розкрийте зміст аксіом неперервності, незалежності, нерівних імовірностей, складеної лотереї.
8. Що означають поняття "лотерея" та "детермінований еквівалент"?
9. Яким чином визначається очікуваний виграш?
10. Розкрийте зміст принципу Неймана – Моргенштерна.
11. Охарактеризуйте ситуацію, коли особа, що приймає рішення, не схильна до ризику.
12. Охарактеризуйте ситуацію, коли особа, що приймає рішення, схильна до ризику.
13. Охарактеризуйте ситуацію, коли особа, що приймає рішення, байдужа до ризику.
14. Розкрийте зміст основних властивостей функції корисності.
15. Які види функції корисності вам відомі?
16. Охарактеризуйте основні етапи побудови функції корисності.

Тема 9. Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття господарських рішень

1. Які підходи до тлумачення ризику вам відомі?
2. У чому сутність конфліктної ситуації?
3. Розкрийте зміст об'єктивно-суб'єктивної теорії ризику.
4. Охарактеризуйте зовнішні та внутрішні джерела ризику.
5. Розкрийте зміст ризику як економічної категорії.
6. Які ознаки ризику вам відомі?
7. Що таке підприємницький ризик?
8. Вкажіть зовнішні чинники ризику.
9. Вкажіть внутрішні чинники ризику.
10. Охарактеризуйте регулятивну функцію ризику.
11. Розкрийте зміст захисної функції ризику.
12. Як класифікуються підприємницькі ризики?

Тема 10. Критерії прийняття господарських рішень за умов ризику

1. Розкрийте основне призначення критеріїв прийняття рішень в умовах ризику.
2. Які критерії застосовуються в процесі прийняття рішень в умовах ризику?
3. Якими є особливості застосування критерію Байєса? Визначте їх.
4. Якими є особливості застосування критерію Ходжена – Лемана? Визначте їх.
5. Напишіть формулу розрахунку критерію Ходжена – Лемана.
6. Визначте сутність критерію очікуваного значення під час обґрунтування господарських рішень за умов ризику.
7. Яким є зміст методу "дерева рішень"?
8. Що покладено в основу використання математичних функцій альтернативних рішень у процесі обґрунтування господарських рішень за умов ризику?
9. Якими є особливості використання апостеріорних імовірностей Байєса в процесі обґрунтування господарських рішень за умов ризику?
10. Розкрийте сутність принципу Бернуллі.

Тема 11. Прийняття рішень у конфліктних ситуаціях

1. Що означають поняття "конфлікт" і "конфліктна ситуація"?
2. Як класифікуються конфлікти?

3. Які міжособистісні методи подолання конфлікту вам відомі?
4. Розкрийте зміст моделі виникнення конфлікту та управління ним.
5. Які наслідки конфлікту? Наведіть їх класифікацію.
6. Які економіко-математичні методи в процесі прийняття господарських рішень використовуються в умовах конфлікту?
7. Яка мета теорії гри в процесі прийняття господарських рішень?
8. Розкрийте основний зміст основних понять теорії гри.
9. За яких умов стратегія гравця є оптимальною?
10. Що означає платіжна матриця та як вона будується?
11. У чому полягає сутність сідлової точки гри?
12. Які стратегії можна віднести до числа чистих стратегій? Обґрунтуйте свій погляд.

Тема 12. Обґрунтування фінансових та інвестиційних рішень за умов ризику

1. Назвіть загальноприйняті показники ефективності інвестиційних проектів.
2. Як можна оцінити фінансово-інвестиційний ризик підприємства?
3. У чому полягає відмінність між систематичним та несистематичним ризиком портфеля інвестицій?
4. За допомогою яких показників можна оцінити ризик окремого фінансового активу?
5. Як оцінюють ризик цінних паперів?
6. Яка роль β -коефіцієнта в процесі оцінки ризику цінних паперів? Які його граничні значення?
7. Як можна здійснити оцінку ризику інвестиційного проекту?
8. Як можна здійснити оцінку ризику і дохідності інвестиційного проекту?

Тема 13. Якісне оцінювання підприємницьких ризиків

1. У чому полягає сутність якісного оцінювання підприємницьких ризиків?
2. Яка група ризиків може бути виявлена в процесі якісного аналізу інвестиційного проекту?
3. Які показники в першу чергу аналізуються під час якісного аналізу проекту?
4. Які методи якісного аналізу підприємницьких ризиків вам відомі?

Тема 14. Кількісне оцінювання підприємницьких ризиків

1. У чому полягає сутність кількісного оцінювання підприємницьких ризиків?
2. Які методи кількісної оцінки вам відомі?
3. Чому експертний метод є найпоширенішим під час оцінки ризику?
4. Розкрийте зміст експертного методу в процесі оцінки підприємницьких ризиків.
5. Охарактеризуйте основні етапи обробки експертних оцінок.
6. У чому полягають особливості застосування статистичного методу оцінки підприємницьких ризиків?
7. Які показники статистичної оцінки ви знаєте?
8. Як здійснюється побудова кривої ризику?
9. Які є переваги та недоліки статистичного методу оцінки підприємницьких ризиків?
10. Охарактеризуйте поняття гранично допустимого рівня ризику.
11. Які зони ризику можна виділити в процесі оцінки підприємницьких ризиків?
12. Які особливості застосування аналітичного методу оцінки підприємницьких ризиків?
13. У чому полягає специфіка методу аналогів?

Тема 15. Основи ризик-менеджменту

1. У чому полягає основна мета ризик-менеджменту?
2. Що є об'єктом управління в ризик-менеджменті?
3. Назвіть елементи системи ризик-менеджменту.
4. Які принципи управління ризиком ви знаєте?
5. У чому полягає основний зміст функції прогнозування у ризик-менеджменті?
6. Розкрийте основний зміст функції організації в ризик-менеджменті.
7. У чому полягає основний зміст функції регулювання в ризик-менеджменті?
8. Розкрийте основний зміст функції координації в ризик-менеджменті?
9. Розкрийте основний зміст функції стимулювання в ризик-менеджменті.
10. Які ще функції ризик-менеджменту вам відомі?

Тема 16. Напрями і методи регулювання та зниження ступеня ризику

1. Охарактеризуйте основні етапи управління ризиком.
2. Якими є способи зниження ступеня ризику? Розкрийте їх сутність і охарактеризуйте.
3. У чому полягає сутність диверсифікації ризику?
4. Яким є зміст хеджування фінансових ризиків?
5. Визначте методи зниження банківського ризику.
6. Визначте методи зниження валютного ризику.

9. Індивідуально-консультативна робота

Індивідуально-консультативна робота здійснюється за графіком індивідуально-консультативної роботи у формі індивідуальних занять, консультацій, перевірки виконання індивідуальних завдань, перевірки та захисту завдань, що винесені на поточний контроль, тощо.

Формами організації індивідуально-консультативної роботи є:

- а) за засвоєнням теоретичного матеріалу:
консультації: індивідуальні (запитання – відповідь), групові (розгляд типових прикладів – ситуацій);
- б) за засвоєнням практичного матеріалу:
консультації індивідуальні та групові;
- в) для комплексної оцінки засвоєння програмного матеріалу:
індивідуальне здавання виконаних робіт.

10. Методи навчання

У процесі викладання навчальної дисципліни для активізації навчально-пізнавальної діяльності студентів передбачене застосування як активних, так і інтерактивних навчальних технологій, серед яких: лекції проблемного характеру, міні-лекції, робота в малих групах, семінари-дискусії, мозкові атаки, кейс-метод, презентації, ознайомлювальні (початкові) ігри, метод проектної роботи, комп'ютерні симуляції, метод Дельфі, метод сценаріїв, банки візуального супроводу (табл. 10.1 і 10.2).

**Розподіл форм та методів активізації процесу навчання
за темами навчальної дисципліни**

Тема	Практичне застосування навчальних технологій
1	2
<i>Тема 1.</i> Сутнісна характеристика господарських рішень	Лекція проблемного характеру з питання "Роль господарських рішень в ефективному функціонуванні підприємства", робота в малих групах, презентація результатів, банки візуального супроводу
<i>Тема 2.</i> Технологія прийняття рішень господарської діяльності	Міні-лекція з питання "Прийняття рішень на підставі методу аналізу ієрархії", банки візуального супроводу
<i>Тема 3.</i> Методичні основи підготовки господарських рішень	Лекція проблемного характеру з питання "Ефективні методи розробки господарських рішень", робота в малих групах, презентація результатів, банки візуального супроводу
<i>Тема 4.</i> Обґрунтування господарських рішень та оцінювання їх ефективності	Міні-лекція з питання "Основні показники ефективності господарських рішень", робота в малих групах, презентація результатів, банки візуального супроводу
<i>Тема 5.</i> Прогнозування та аналіз господарських рішень	Лекція проблемного характеру з питання "Роль методів прогнозування в процесі прийняття ефективних господарських рішень", робота в малих групах, презентація результатів, банки візуального супроводу
<i>Тема 6.</i> Невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності	Лекція проблемного характеру з питання "Методи опису невизначеності"
<i>Тема 7.</i> Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності	Міні-лекція з питання "Правила і критерії прийняття рішень в умовах невизначеності", банки візуального супроводу
<i>Тема 8.</i> Теорія корисності та її застосування у процесах прийняття рішень	Міні-лекція з питання "Оцінка схильності ОПР до ризику", банки візуального супроводу
<i>Тема 9.</i> Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття господарських рішень	Лекція проблемного характеру з питання "Причини виникнення ризиків на підприємстві", робота в малих групах, презентація результатів, банки візуального супроводу
<i>Тема 10.</i> Критерії прийняття господарських рішень за умов ризику	Міні-лекція з питання "Правила і критерії прийняття рішень в умовах ризику", банки візуального супроводу

1	2
<i>Тема 11.</i> Прийняття рішень у конфліктних ситуаціях	Міні-лекція з питання "Математичні методи прийняття господарських рішень в умовах ризику", банки візуального супроводу
<i>Тема 12.</i> Обґрунтування фінансових та інвестиційних рішень за умов ризику	Лекція проблемного характеру з питання "Критерії ефективності фінансових та інвестиційних ризиків", робота в малих групах, презентація результатів, банки візуального супроводу
<i>Тема 13.</i> Якісне оцінювання підприємницьких ризиків	Міні-лекція з питання "Якісні методи оцінки підприємницьких ризиків", банки візуального супроводу
<i>Тема 14.</i> Кількісне оцінювання підприємницьких ризиків	Міні-лекція з питання "Кількісні методи оцінки підприємницьких ризиків", банки візуального супроводу
<i>Тема 15.</i> Основи ризик-менеджменту	Лекція проблемного характеру з питання "Значущість ризик-менеджменту в підприємницькій діяльності", робота в малих групах, презентація результатів, банки візуального супроводу
<i>Тема 16.</i> Напрями і методи регулювання та зниження ступеня ризику	Міні-лекція з питання "Методи зниження ступеня ризику", банки візуального супроводу

Основні відмінності активних та інтерактивних методів навчання від традиційних визначаються не тільки методикою і технікою викладання, але й високою ефективністю навчального процесу, який виявляється у: високій мотивації студентів; закріпленні теоретичних знань на практиці; підвищенні самосвідомості студентів; формуванні здатності приймати самостійні рішення; формуванні здатності до ухвалення колективних рішень; формуванні здатності до соціальної інтеграції; набуття навичок вирішення конфліктів; розвитку здатності до знаходження компромісів.

Лекції проблемного характеру – один із найважливіших елементів проблемного навчання студентів. Вони передбачають поряд із розглядом основного лекційного матеріалу встановлення та розгляд кола проблемних питань дискусійного характеру, які недостатньо розроблені в науці й мають актуальне значення для теорії та практики. Лекції проблемного характеру відрізняються поглибленою аргументацією матеріалу, що викладається. Вони сприяють формуванню у студентів самостійного творчого мислення, прищеплюють їм пізнавальні навички. Студенти стають учасниками наукового пошуку та вирішення проблемних ситуацій.

Міні-лекції передбачають викладення навчального матеріалу за короткий проміжок часу й характеризуються значною ємністю, складністю логічних побудов, образів, доказів та узагальнень. Вони проводяться, як правило, як частина заняття-дослідження. Міні-лекції відрізняються від повноформатних лекцій значно меншою тривалістю. Зазвичай міні-лекції тривають не більше 10 – 15 хвилин і використовуються для того, щоб стисло донести нову інформацію до всіх слухачів. Міні-лекції часто застосовуються як частини цілісної теми, яку бажано викладати повноформатною лекцією, щоб не втомлювати аудиторію. Тоді інформація надається по черзі кількома окремими сегментами, між якими застосовуються інші форми й методи навчання.

Семінари-дискусії передбачають обмін думками і поглядами учасників з приводу даної теми, а також розвивають мислення, допомагають формувати погляди та переконання, виробляють вміння формулювати думки й висловлювати їх.

Робота в малих групах дає змогу структурувати практично-семінарські заняття за формою і змістом, створює можливості для участі кожного студента в роботі за темою заняття, забезпечує формування особистісних якостей та досвіду соціального спілкування.

Мозкові атаки – метод розв'язання невідкладних завдань, сутність якого полягає в тому, щоб висловити якомога більшу кількість ідей за дуже обмежений проміжок часу, обговорити і здійснити їх селекцію.

Презентації – виступи перед аудиторією, що використовуються для представлення певних досягнень, результатів роботи групи звіту про виконання індивідуальних завдань, проектних робіт. Презентації можуть бути як індивідуальними, наприклад виступ одного слухача, так і колективними, тобто виступи двох та більше слухачів.

Метод Дельфі використовується з метою досягнення консенсусу в експертних оцінках і передбачає надання можливості висловити свої думки групі експертів, що працюють індивідуально в різних місцях. При виборі управлінського рішення за цим методом академічну групу розділяють, наприклад, на п'ять малих груп. Чотири групи є робочими, вони розробляють і приймають управлінське рішення, а п'ята група є експертною. Аналіз та варіанти управлінських рішень робочих груп усереднюються цією групою. Експертна група може бути поділена за спеціалізаціями.

Комп'ютерна симуляція (гра) – це метод навчання, що спирається на використання спеціальних комп'ютерних програм, за допомогою яких можливе віртуальне моделювання бізнес-процесу. Студенти можуть змінювати параметри й дані, приймати рішення та аналізувати наслідки таких рішень. Метою використання даного методу є розвиток системного мислення студентів, їх здібностей до планування, формування вмінь розпізнавати й аналізувати проблеми, порівнювати й оцінювати альтернативи, приймати оптимальні рішення й діяти в умовах обмеженого часу.

Метод сценаріїв полягає в розробці ймовірних моделей поведінки та розвитку конкретних явищ у перспективі.

Банки візуального супроводу сприяють активізації процесу навчання за темами навчальної дисципліни за допомогою наочності.

Таблиця 10.2

Використання методик активізації процесу навчання

Тема навчальної дисципліни	Практичне застосування методик	Методики активізації процесу навчання
<i>Тема 1.</i> Сутнісна характеристика господарських рішень	<i>Семінарське заняття.</i> Тема: "Особливості розвитку теорії про господарські рішення: історичний та сучасний аспекти"	Семінари-дискусії, презентації
<i>Тема 2.</i> Технологія прийняття рішень господарської діяльності	<i>Завдання 1.</i> Прийняття господарських рішень з використанням методу аналізу ієрархії	Робота в малих групах, мозкові атаки, метод Дельфі
<i>Тема 6.</i> Невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності	<i>Семінарське заняття.</i> Тема: "Невизначеність – фундаментальна характеристика економічних процесів"	Семінари-дискусії, презентації
<i>Тема 13.</i> Якісне оцінювання підприємницьких ризиків	<i>Завдання 13.</i> Експертна оцінка рівня ризику діяльності підприємства	Робота в малих групах, мозкові атаки
<i>Тема 15.</i> Основи ризик-менеджменту	<i>Завдання 15.</i> Комплексне оцінювання ризиків підприємства з використанням методів теорії нечітких множин	Робота в малих групах, мозкові атаки, метод Дельфі, комп'ютерна симуляція, метод сценаріїв, презентації

11. Методи контролю

Система оцінювання сформованих компетентностей (див. табл. 2.1) у студентів враховує види занять, які згідно з програмою навчальної дисципліни передбачають лекційні, семінарські, практичні заняття, а також виконання самостійної роботи. Оцінювання сформованих компетентностей у студентів здійснюється за накопичувальною 100-бальною системою. Відповідно до Тимчасового положення "Про порядок оцінювання результатів навчання студентів за накопичувальною бально-рейтинговою системою" ХНЕУ, контрольні заходи включають:

поточний контроль, що здійснюється протягом семестру під час проведення лекційних, практичних, семінарських занять і оцінюється сумою набраних балів (максимальна сума – 60 балів; мінімальна сума, що дозволяє студенту скласти іспит, – 35 балів);

модульний контроль, що проводиться з урахуванням поточного контролю за відповідний змістовий модуль і має на меті *інтегровану* оцінку результатів навчання студента після вивчення матеріалу з логічно завершеної частини дисципліни – змістового модуля;

підсумковий/семестровий контроль, що проводиться у формі семестрового екзамену, відповідно до графіку навчального процесу.

Поточний контроль з даної навчальної дисципліни проводиться в таких формах:

активна робота на лекційних заняттях;

активна участь у виконанні практичних завдань;

активна участь у дискусії та презентації матеріалу на семінарських заняттях;

захист індивідуального та комплексного розрахункового завдання;

перевірка есе за заданою тематикою;

проведення поточного тестування;

проведення письмової контрольної роботи;

експрес-опитування;

проведення диктанту за лекційним матеріалом.

Модульний контроль з даної навчальної дисципліни проводиться у формі колоквиуму. **Колоквиум** – це форма перевірки й оцінювання знань студентів у системі освіти у вищих навчальних закладах. Проводиться як проміжний міні-екзамен з ініціативи викладача.

Підсумковий/семестровий контроль проводиться у формі семестрового екзамену. **Семестрові екзамени** – форма оцінювання підсумкового засвоєння студентами теоретичного та практичного матеріалу з окремої навчальної дисципліни, що проводиться як контрольний захід.

Порядок проведення поточного оцінювання знань студентів. Оцінювання знань студента під час семінарських і практичних занять та виконання індивідуальних завдань проводиться за накопичувальною 100-бальною системою за такими критеріями:

розуміння, ступінь засвоєння теорії та методології проблем, що розглядаються;

ступінь засвоєння фактичного матеріалу навчальної дисципліни; ознайомлення з рекомендованою літературою, а також із сучасною літературою з питань, що розглядаються;

вміння поєднувати теорію з практикою при розгляді виробничих ситуацій, розв'язанні задач, проведенні розрахунків у процесі виконання індивідуальних завдань та завдань, винесених на розгляд в аудиторії;

логіка, структура, стиль викладу матеріалу в письмових роботах і під час виступів в аудиторії, вміння обґрунтовувати свою позицію, здійснювати узагальнення інформації та робити висновки;

арифметична правильність виконання індивідуального та комплексного розрахункового завдання.

Максимально можливий бал за конкретним завданням ставиться за умови відповідності індивідуального завдання студента або його усної відповіді всім зазначеним критеріям. Відсутність тієї або іншої складової знижує кількість балів. При оцінюванні індивідуальних завдань увага також приділяється якості, самостійності та своєчасності здачі виконаних завдань викладачу, згідно з графіком навчального процесу. Якщо якась із вимог не буде виконана, то бали будуть знижені.

Поточний тестовий контроль проводиться 2 рази за семестр. Тест включає запитання одиничного і множинного вибору щодо перевірки знань основних категорій навчальної дисципліни.

Письмова контрольна робота проводиться 2 рази за семестр та включає практичні завдання різного рівня складності відповідно до тем змістового модуля.

Критерії оцінювання позааудиторної самостійної роботи студентів. Загальними критеріями, за якими здійснюється оцінювання позааудиторної самостійної роботи студентів, є: глибина і міцність знань, рівень мислення,

вміння систематизувати знання за окремими темами, вміння робити обґрунтовані висновки, володіння категорійним апаратом, навички і прийоми виконання практичних завдань, вміння знаходити необхідну інформацію, здійснювати її систематизацію та обробку, самореалізація на практичних та семінарських заняттях.

Критеріями оцінювання есе є:

здатність проводити критичну та незалежну оцінку певних проблемних питань;

вміння пояснювати альтернативні погляди та наявність власної точки зору, позиції на певне проблемне питання;

застосування аналітичних підходів;

якість і чіткість викладення міркувань;

логіка, структуризація та обґрунтованість висновків щодо конкретної проблеми;

самостійність виконання роботи;

грамотність подачі матеріалу;

використання методів порівняння, узагальнення понять та явищ;

оформлення роботи.

Порядок підсумкового контролю з навчальної дисципліни.

Підсумковий контроль знань та компетентностей студентів з навчальної дисципліни здійснюється на підставі проведення семестрового екзамену. Екзаменаційний білет охоплює програму дисципліни і передбачає визначення рівня знань та ступеня опанування студентами компетентностей (див. табл. 2.1).

Завданням екзамену є перевірка розуміння студентом програмного матеріалу в цілому, логіки та взаємозв'язків між окремими розділами, здатності творчого використання накопичених знань, вміння формулювати своє ставлення до певної проблеми навчальної дисципліни тощо. В умовах реалізації компетентнісного підходу екзамен оцінює рівень засвоєння студентом компетентностей, що передбачені кваліфікаційними вимогами. Кожен екзаменаційний білет складається з 5 практичних ситуацій, які передбачають вирішення типових професійних завдань фахівця на робочому місці та дозволяють діагностувати рівень теоретичної підготовки студента і рівень його компетентності з навчальної дисципліни.

Екзаменаційний білет включає два стереотипних, два діагностичних та одне евристичне завдання, які оцінюються відповідно до Тимчасового

положення "Про порядок оцінювання результатів навчання студентів за накопичувальною бально-рейтинговою системою" ХНЕУ.

Студент, який із поважних причин, підтверджених документально, не мав можливості брати участь у формах поточного контролю, тобто не склав змістовий модуль, має право на його відпрацювання у двотижневий термін після повернення до навчання за розпорядженням декана факультету відповідно до встановленого терміну.

Студент **не може бути допущений** до складання екзамену, якщо кількість балів, одержаних за результатами перевірки успішності під час поточного та модульного контролю відповідно до змістового модуля впродовж семестру, в сумі не досягла 35 балів. Після екзаменаційної сесії декан факультету видає розпорядження про ліквідацію академічної заборгованості. У встановлений термін студент добирає залікові бали.

Студента слід **вважати атестованим**, якщо сума балів, одержаних за результатами підсумкової/семестрової перевірки успішності, дорівнює або перевищує 60. Мінімально можлива кількість балів за поточний і модульний контроль упродовж семестру – 35 та мінімально можлива кількість балів, набраних на екзамені, – 25.

Результат семестрового екзамену оцінюється в балах (максимальна кількість – 40 балів, мінімальна кількість, що зараховується, – 25 балів) і проставляється у відповідній графі *екзаменаційної "Відомості обліку успішності"*.

Підсумкова оцінка з навчальної дисципліни розраховується з урахуванням балів, отриманих під час екзамену, та балів, отриманих під час поточного контролю за накопичувальною системою. Сумарний результат у балах за семестр складає: *"60 і більше балів – зараховано"*, *"59 і менше балів – не зараховано"* та заноситься у залікову *"Відомість обліку успішності"* навчальної дисципліни. У випадку отримання менше 60 балів студент обов'язково здає залік після закінчення екзаменаційної сесії у встановлений деканом факультету термін, але не пізніше двох тижнів після початку семестру. У випадку повторного отримання менше 60 балів декан факультету призначає комісію у складі трьох викладачів на чолі із завідувачем кафедри та визначає термін перескладання заліку, після чого приймається рішення відповідно до чинного законодавства: "зараховано" – студент продовжує навчання за графіком навчального процесу, а якщо "не зараховано", тоді декан факультету пропонує студенту повторно вивчення навчальної дисципліни протягом наступного навчального періоду самостійно.

Зразок екзаменаційного білета

Форма № Н-5.05

Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця
Освітньо-кваліфікаційний рівень "бакалавр"
Напрямок підготовки: "Економіка підприємства". Семестр VII
Навчальна дисципліна "Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків"

ЕКЗАМЕНАЦІЙНИЙ БІЛЕТ № 1

Завдання 1 (стереотипне). Сільськогосподарське підприємство планує здійснити вихід на нові міжнародні ринки в таких країнах, як Японія (X_1), Грузія (X_2), Єгипет (X_3), з новинкою. Для кожного з ринку експертним шляхом було встановлено очікувані значення прибутку (тис. грн) з урахуванням політичної ситуації та ступеня конкуренції (табл. 1). Необхідно визначити оптимальний товарний ринок, на якому підприємство зможе отримати гарантований прибуток від реалізації новинки за будь-яких змін зовнішнього середовища.

Таблиця 1

Очікувані значення прибутку для товарних ринків (тис. грн)

Нові товарні ринки	Політична ситуація			
	стабільна	стабільна	нестабільна	нестабільна
	Ступінь конкуренції			
	слабкий	сильний	слабкий	сильний
Ринок X_1	670	530	380	240
Ринок X_2	580	460	300	200
Ринок X_3	520	480	260	245

Завдання 2 (стереотипне). Компанія KOMANDOR вивчає для себе можливість участі в лотереї, яка описується як така, що з імовірністю 0,55 приводить до результату 45 тис. грн та з імовірністю 0,45 – 50 тис. грн ($L(45;0,55;50;0,45)$). Функція корисності має вигляд $U(x)=e^{-0,1x}$. Знайдіть за варіантами очікуваний виграш, детермінований еквівалент та премію за ризик. Вкажіть тип ставлення ОПР до ризику за заданою функцією корисності.

Завдання 3 (діагностичне). Працівники компанії Apple проводять оцінку трьох альтернативних проектів щодо виробництва товарів: iPhone 5G (А), iPhone 5S (Б) та iPhone 5GS (В). На підставі попереднього сценарного аналізу проектів були визначені можливі доходи від їх реалізації при різних сценаріях розвитку зовнішнього середовища, а саме: оптимістичного, реалістичного та песимістичного (табл. 2). Необхідно визначити найменш ризикований проект.

Таблиця 2

Вихідні дані

Показник	Проект А			Проект Б			Проект В		
	Оптимістичний сценарій	Реалістичний сценарій	Песимістичний сценарій	Оптимістичний сценарій	Реалістичний сценарій	Песимістичний сценарій	Оптимістичний сценарій	Реалістичний сценарій	Песимістичний сценарій
ЧПД, тис. грн	55	40	30	60	45	20	60	50	25
Імовірність реалізації сценарію	0,25	0,60	0,15	0,35	0,40	0,25	0,25	0,50	0,25

Завдання 4 (діагностичне). Необхідно скласти оптимальний план перевезень товарів за умови, що всі запаси від постачальників будуть вивезені, а споживач точно отримає необхідну кількість товару. Оптимальний план перевезень слід визначити на основі методу потенціалів, опорний – на основі методу мінімальної вартості. Вартість доставки одиниці товару з кожного пункту відправлення у відповідні пункти призначення задана матрицею тарифів (табл. 3).

Таблиця 3

Запаси	Потреби			
	220	160	130	160
110	5	9	10	4
370	2	9	6	6
190	3	5	4	7

Завдання 5 (евристичне). На підставі даних табл. 4 щодо обсягів реалізації елітного насіння соняшника за 2010 – 2013 рр. побудуйте прогноз на 2015 р. (на всі квартали), використовуючи мультиплікативну модель декомпозиції часового ряду. Як сезонну складову слід обрати модифіковану середню. Побудуйте графік центрованої ковзної середньої та тренда.

Таблиця 4

Вихідні дані

Рік	Квартал	Обсяг реалізації, тис. грн
2010	1	29,35
	2	32,40
	3	40,25
	4	36,70
2011	1	33,90
	2	37,50
	3	42,36
	4	40,10
2012	1	40,00
	2	42,35
	3	45,70
	4	42,35
2013	1	43,50
	2	44,70
	3	48,20
	4	47,50

Затверджено на засіданні кафедри економіки підприємства та менеджменту ХНЕУ ім. С. Кузнеця.
 Протокол № ___ від "___" _____ 20___ р.

Зав. кафедри _____ Екзаменатор _____
 (підпис) (підпис)

Підсумкові бали за екзамен складаються із суми балів за виконання всіх завдань, що округлені до цілого числа за правилами математики.

Алгоритм вирішення кожного завдання включає окремі етапи, які відрізняються за складністю, трудомісткістю та значенням для розв'язання завдання. Тому окремі завдання та етапи їх розв'язання оцінюються відокремлено один від одного таким чином:

Завдання 1 (2,5 бала):

0,5 бала – за правильне подання та використання методичного апарату, зокрема формули розрахунку критерію Вальда;

1 бал – за арифметичну правильність розрахунку критерію Вальда;

0,5 бала – за наявність і ґрунтовність висновку;

0,25 бала – за охайність подання результатів;

0,25 бала – за наявність пояснень щодо алгоритму розрахунку показників.

Завдання 2 (5 балів):

0,15 бала – за правильне подання та використання методичного апарату, зокрема формули розрахунку очікуваного виграшу;

1 бал – за арифметичну правильність розрахунку очікуваного виграшу;

0,15 бала – за правильне подання та використання методичного апарату, зокрема формули розрахунку очікуваної корисності;

1 бал – за арифметичну правильність розрахунку очікуваної корисності;

0,1 бала – за правильне подання та використання методичного апарату, зокрема формули розрахунку детермінованого еквіваленту;

1 бал – за арифметичну правильність розрахунку детермінованого еквіваленту;

0,1 бала – за правильне подання та використання методичного апарату, зокрема формули розрахунку премії за ризик;

1 бал – за арифметичну правильність розрахунку премії за ризик;

0,25 бала – за охайність подання результатів;

0,25 бала – за наявність і ґрунтовність висновку.

Завдання 3 (7,5 бала):

0,25 бала – за логіку розрахунків;

0,25 бала – за правильне подання та використання методичного апарату, зокрема формули розрахунку очікуваного середнього значення прибутку;

1,5 бала – за арифметичну правильність розрахунків очікуваного середнього значення прибутку за заходами;

0,25 бала – за правильне подання та використання методичного апарату, зокрема формули розрахунку дисперсії прибутку;

1,5 бала – за арифметичну правильність розрахунків дисперсії прибутку за заходами;

0,25 бала – за правильне подання та використання методичного апарату, зокрема формули розрахунку середньоквадратичного відхилення прибутку;

1,5 бала – за арифметичну правильність розрахунків середньоквадратичного відхилення прибутку за проектами;

0,25 бала – за правильне подання та використання методичного апарату, зокрема формули розрахунку міри ризику;

1 бал – за арифметичну правильність розрахунків міри ризику за заходами;

0,25 бала – за наявність пояснень до алгоритму розрахунку показників;

0,25 бала – за охайність подання результатів;

0,25 бала – за наявність і ґрунтовність висновку.

Завдання 4 (10 балів):

0,25 бала – за логіку розрахунків;

0,5 бала – за правильне подання та використання методичного апарату, зокрема аналітичного опису достатньої умови розв'язання транспортної задачі;

1 бал – за арифметичну правильність розрахунку достатньої умови розв'язання транспортної задачі;

0,5 бала – правильне подання та використання методичного апарату щодо отримання опорного плану перевезень на основі методу мінімальної вартості;

2 бали – за арифметичну правильність розрахунку опорного плану перевезень на основі методу мінімальної вартості;

1 бал – за арифметичну правильність розрахунку сукупних транспортних витрат за опорним планом;

0,5 бала – за правильне подання та використання методичного апарату щодо отримання оптимального плану перевезень за допомогою методу потенціалів;

3 бали – за арифметичну правильність розрахунку оптимального плану перевезень продукції на основі методу потенціалів;

0,5 бала – за арифметичну правильність розрахунку сукупних транспортних витрат за оптимальним планом;

0,25 бала – за наявність пояснень до алгоритму розрахунку показників;

- 0,25 бала – за охайність подання результатів;
- 0,25 бала – за наявність і ґрунтовність висновку.

Завдання 5 (15 балів):

- 0,25 бала – за логіку розрахунку показників;
- 0,25 бала – за правильне аналітичне подання мультиплікативної моделі декомпозиції часового ряду;
- 0,25 бала – за правильне подання та використання методичного апарату, зокрема формули розрахунку простої ковзної середньої;
- 0,5 бала – за арифметичну правильність розрахунків значень простої ковзної середньої за період, що досліджується;
- 0,25 бала – за правильне подання та використання методичного апарату, зокрема формули розрахунку центрованої ковзної середньої;
- 0,5 бала – за арифметичну правильність розрахунків значень центрованої ковзної середньої за період, що досліджується;
- 0,5 бала – за правильне подання та використання методичного апарату, зокрема формули розрахунку параметрів трендової моделі;
- 3 бали – за арифметичну правильність розрахунків параметрів трендової моделі за період, що досліджується;
- 2 бали – за арифметичну правильність розрахунків значень обсягів реалізації елітного насіння соняшника на основі трендової моделі за період, що досліджується;
- 0,25 бала – за правильне подання та використання методичного апарату, зокрема формули розрахунку коефіцієнта зміни обсягів реалізації;
- 0,5 бала – за арифметичну правильність розрахунків значень коефіцієнта зміни обсягів реалізації за період, що досліджується;
- 0,25 бала – за правильне подання та використання методичного апарату, зокрема формули розрахунку сезонної складової;
- 2,5 бала – за арифметичну правильність розрахунків значень сезонної складової за період, що досліджується;
- 0,25 бала – за правильне подання та використання методичного апарату, зокрема формули розрахунку циклічної складової;
- 2 бали – за арифметичну правильність розрахунків значень циклічної складової за період, що досліджується;
- 0,25 бала – за правильне подання та використання методичного апарату, зокрема формули розрахунку випадкової складової;
- 0,25 бала – за арифметичну правильність розрахунків значень випадкової складової за період, що досліджується;

0,25 бала – за правильну побудову графіку центрованої ковзної середньої та тренда;

0,25 бала – за арифметичну правильність розрахунку прогнозних значень обсягів реалізації елітного насіння соняшника з урахуванням усіх складових мультиплікативної моделі;

0,25 бала – за наявність пояснень щодо алгоритму розрахунку показників;

0,25 бала – за охайність подання результатів;

0,25 бала – за наявність і ґрунтовність висновку.

12. Розподіл балів, які отримують студенти

Система оцінювання рівня сформованості професійних компетентностей студентів денної форми навчання наведена в табл. 12.1.

Таблица 12.1

Система оцінювання рівня сформованості професійних компетентностей

Професійні компетентності	Навчальний тиждень	Год	Методи та форми навчання	ОЦІНКА рівня сформованості компетентностей				
				Форми контролю	Максимальний бал			
1	2	3	4	5	6			
Змістовий модуль 1.					30,5			
Теоретичні та методологічні засади прийняття господарських рішень								
ОГРІОР 2	Визначати способи формалізації й реалізації господарських рішень	1	Ауд.	2	Лекція	Тема 1. Сутнісна характеристика господарських рішень	Робота на лекції	0,5
				2	Семінарське заняття	Тема семінарського заняття "Особливості розвитку теорії про господарські рішення: історичний та сучасний аспекти": 1. Генезис науки про управлінські рішення та її зв'язок з іншими науками. 2. Особливості сучасного розвитку теорії про господарські рішення. 3. Основні відмінності управлінських рішень від інших рішень. 4. Роль господарських рішень у підвищенні ефективності функціонування суб'єктів економічної діяльності. Напрями підвищення ефективності господарських рішень	Активна участь у дискусії	1

Продовження табл. 12.1

1	2	3	4	5	6			
					5. Специфіка проблем прийняття господарських рішень на підприємствах України			
		CPC	5	Підготовка до занять	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до семінарського заняття, огляд теоретичного матеріалу за темою "Особливості розвитку теорії про господарські рішення: історичний та сучасний аспекти"	Презентація	0,5	
ОГРІОР 3	Визначати технологію розробки та реалізації господарських рішень	2	Ауд.	2	Лекція	Тема 2. Технологія прийняття рішень господарської діяльності	Робота на лекції	0,5
				2	Практичне заняття	Завдання 1. Прийняття господарських рішень із використанням методу аналізу ієрархії	Активна участь у виконанні практичних завдань	0,5
			CPC	5	Підготовка до занять	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до практичного заняття. Підготовка до контрольної роботи за темами 1 і 2. Виконання індивідуального завдання "Прийняття господарських рішень із використанням методу аналізу ієрархії"	Захист індивідуального завдання	1,5
ОГРІОР 2	Здійснювати обґрунтований вибір економіко-математичних методів та моделей для формування ефективних господарських рішень	3	Ауд.	2	Лекція	Тема 3. Методичні основи підготовки господарських рішень	Робота на лекції	0,5
				2	Практичне заняття	Завдання 2. Планування випуску продукції за допомогою графічного методу та симплекс-методу лінійного програмування	Активна участь у виконанні практичних завдань	0,5
			CPC	7	Підготовка до занять	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до практичних занять. Виконання індивідуального завдання "Планування випуску продукції за допомогою графічного методу та симплекс-методу лінійного програмування"	Захист індивідуального завдання	1,5
		4	Ауд.	2	Лекція	Тема 3. Методичні основи підготовки господарських рішень	Робота на лекції	0,5
				2	Практичне заняття	Завдання 3. Вибір оптимального плану перевезень продукції	Активна участь у виконанні практичних завдань	0,5
			CPC	6	Підготовка до занять	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до практичних занять. Виконання індивідуального завдання "Вибір оптимального плану перевезень продукції"	Захист індивідуального завдання	1,5

Продовження табл. 12.1

1	2	3	4	5	6			
ОГРІОР 3	Формувати напрями підвищення ефективності господарських рішень	5	Ауд.	2	Лекція	Тема 4. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання їх ефективності	Робота на лекції	0,5
			Ауд.	2	Практичне заняття	Завдання 4. Вибір інвестиційного проекту за допомогою методу максимінної згортки	Активна участь у виконанні практичних завдань	0,5
			СРС	6	Підготовка до занять	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою. Виконання індивідуального завдання "Вибір інвестиційного проекту за допомогою методу максимінної згортки"	Захист індивідуального завдання	1
ОГРІОР 2	Прогнозувати господарські рішення з урахуванням впливу чинників	6	Ауд.	2	Лекція	Тема 5. Прогнозування та аналіз господарських рішень	Робота на лекції	0,5
			Ауд.	2	Лабораторне заняття	Завдання 5. Прийняття рішень на основі прогнозування результатів діяльності підприємства	Активна участь у виконанні практичних завдань	0,5
			СРС	6	Підготовка до занять	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до практичних занять. Вирішення індивідуального завдання "Прогнозування результатів діяльності підприємства на підставі декомпозиції часового ряду"	Захист індивідуального завдання	2
ОГРІОР 1	Проводити аналіз впливу невизначеності на якість прийняття господарських рішень	7	Ауд.	2	Лекція	Тема 6. Невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності	Робота на лекції	0,5
			Ауд.	2	Семинарське заняття	Тема семінарського заняття "Невизначеність – фундаментальна характеристика економічних процесів": 1. Сучасні підходи до визначення природи невизначеності. 2. Види невизначеності. Аналіз чинників невизначеності. 3. Взаємозв'язок невизначеності та ризику. 4. Математичні методи формалізації невизначеної інформації. 5. Ризик як методологія подолання невизначеності	Активна участь у дискусії	0,5
			СРС	6	Підготовка до занять	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою, підготовка до практичних занять. Підготовка до семінарського заняття "Невизначеність – фундаментальна характеристика економічних процесів". Підготовка до колоквиуму	Презентація	1

Продовження табл. 12.1

1	2	3	4	5	6		
Визначати оптимальні господарські рішення в умовах невизначеності	8	Ауд.	2	Лекція	Тема 7. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності	Робота на лекції	0,5
			2	Практичне заняття	Теоретичні та методичні засади прийняття господарських рішень	Колоквіум	5
		СРС	7	Підготовка до занять	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до практичних занять. Виконання індивідуального завдання "Обґрунтування господарських рішень в умовах невизначеності та ризику (критерії Лапласа, Вальда, Севіджа, Гурвіца, оптимізму, песимізму, критерії Байєса, Ходжена – Лемана, принцип Бернуллі)"	Захист індивідуального завдання	1,5
Змістовий модуль 2. Прийняття господарських рішень в умовах ризику						29,5	
Визначати схильність ОПР до ризику з використанням теорії корисності	9	Ауд.	2	Лекція	Тема 8. Теорія корисності та її застосування у процесах прийняття рішень	Робота на лекції	0,5
			2	Практичне заняття	Завдання 6. Оцінка схильності ОПР до ризику з використанням теорії корисності	Активна участь у виконанні практичних завдань	0,5
		СРС	5	Підготовка до занять	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою. Виконання індивідуального завдання "Побудова функції корисності ОПР", виконання ІНДЗ "Формування ефективних господарських рішень на підприємстві з урахуванням ризику"	Захист індивідуального завдання	1
Ідентифікувати підприємницькі ризики	10	Ауд.	2	Лекція	Тема 9. Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття господарських рішень	Робота на лекції	0,5
			2	Практичне заняття	Завдання 7. Вибір оптимального інноваційного проекту на основі дерева рішень	Активна участь у виконанні практичних завдань	0,5
		СРС	5	Підготовка до занять	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до практичних занять. Виконання есе на тему "Збутові ризики та причини їх виникнення", виконання ІНДЗ	Перевірка есе	1
Визначати оптимальні господарські рішення в умовах ризику	11	Ауд.	2	Лекція	Тема 10. Критерії прийняття господарських рішень за умов ризику	Робота на лекції	0,5
			2	Практичне заняття	Завдання 8. Обґрунтування господарських рішень в умовах ризику (критерії Байєса, Ходжена – Лемана)	Активна участь у виконанні практичних завдань	0,5
						Тестування	2

Продовження табл. 12.1

1	2	3	4	5	6		
		CPC	5	Підготовка до занять	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою. Виконання есе на тему "Порівняльна характеристика критеріїв прийняття рішень в умовах ризику", виконання ІНДЗ	Перевірка есе	1
ОГРІОР 2	Визначати оптимальні господарські рішення в умовах конфлікту	Ауд.	2	Лекція	Тема 11. Прийняття рішень у конфліктних ситуаціях	Робота на лекції	0,5
			2	Практичне заняття	Завдання 9. Вибір оптимальної стратегії в умовах конфлікту	Активна участь у виконанні практичних завдань	0,5
		CPC	6	Підготовка до занять	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою. Самостійне опрацювання лекційного матеріалу: 1. Теорія кінцевих антагоністичних ігор. 2. Модель торгів. 3. Графоаналітичний спосіб пошуку оптимального рішення за конфліктної ситуації. Виконання ІНДЗ	Експресопитування	0,5
ОГРІОР 3	Здійснювати оцінку ефективності портфелів цінних паперів з урахуванням ризику	Ауд.	2	Лекція	Тема 12. Обґрунтування фінансових та інвестиційних рішень за умов ризику	Робота на лекції	0,5
			2	Практичне заняття	Завдання 10. Оцінка ризику цінних паперів. Завдання 11. Оцінка ризику інвестиційних проектів	Активна участь у виконанні практичних завдань	0,5
		CPC	5	Підготовка до занять	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою. Вирішення індивідуального завдання "Оцінка ризику інвестиційних проектів", виконання ІНДЗ	Захист індивідуального завдання	1,5
ОГРІОР 2	Застосовувати методи експертних оцінок для визначення ступеня ризику	Ауд.	2	Лекція	Тема 13. Якісне оцінювання підприємницьких ризиків	Робота на лекції	0,5
			2	Практичне заняття	Завдання 12. Експертна оцінка рівня ризику діяльності підприємства	Активна участь у виконанні практичних завдань	0,5
		CPC	6	Підготовка до занять	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до практичних занять. Вирішення індивідуального завдання "Експертна оцінка рівня ризику діяльності підприємства", виконання ІНДЗ	Письмова контрольна робота	3
					Захист індивідуального завдання		1

Закінчення табл. 12.1

1		2	3	4		5	6	
ОГРІОР 2	Здійснювати оцінку абсолютного рівня ризику	15	Ауд.	2	Лекція	Тема 14. Кількісне оцінювання підприємницьких ризиків	Робота на лекції	0,5
			2	Практичне заняття	Завдання 13. Статистичний та аналітичний методи кількісної оцінки ризиків	Активна участь у виконанні практичних завдань	0,5	
			СРС	7	Підготовка до занять	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до практичних занять. Вирішення індивідуального завдання "Статистичний та аналітичний методи кількісної оцінки ризиків", виконання ІНДЗ	Захист індивідуального завдання	1,5
ОГРІОР 3	Визначати інтегральні показники оцінки ризику фінансово-господарської діяльності підприємства	16	Ауд.	2	Лекція	Тема 15. Основи ризик-менеджменту	Робота на лекції	0,5
			2	Лабораторне заняття	Завдання 14. Комплексне оцінювання ризиків підприємства з використанням методів теорії нечітких множин	Активна участь у виконанні практичних завдань	0,5	
			СРС	5	Підготовка до занять	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою. Самостійне опрацювання лекційного матеріалу: 1. Формування комплексної системи ризик-менеджменту на підприємствах. 2. Оцінювання ефективності системи ризик-менеджменту. Виконання ІНДЗ. Підготовка до колоквиуму	Експрес-опитування	0,5
	Формувати напрями зниження ступеня ризику діяльності підприємства	17	Ауд.	2	Лекція	Тема 16. Напрями і методи регулювання та зниження ступеня ризику	Робота на лекції	0,5
			2	Практичне заняття	Прийняття господарських рішень в умовах ризику	Колоквиум	6	
			СРС	6	Підготовка до занять	Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до практичного заняття, підготовка до колоквиуму. Підготовка презентації індивідуального науково-дослідного завдання "Формування ефективних господарських рішень на підприємстві з урахуванням ризику"	Захист ІНДЗ	2
СЕСІЯ		Ауд.	2	Передекзаменаційна консультація	Вирішення практичних завдань на різні теми, що входять до підсумкового контролю	Підсумковий контроль	40	
			2	Екзамен	Виконання завдань екзаменаційного білету			
			СРС	10	Підготовка до екзамену			Повторення матеріалів змістових модулів
Усього годин			180	Загальна максимальна кількість балів із дисципліни			100	
з них								
<i>аудиторні</i>			72	40 %	<i>поточний контроль</i>		60	
<i>самостійна робота</i>			108	60 %	<i>підсумковий контроль</i>		40	

Розподіл балів у межах тем змістових модулів наведено в табл. 12.2.

Таблиця 12.2

Розподіл балів за темами

Поточне тестування та самостійна робота															Підсумковий тест (екзамен)	Сума	
Змістовий модуль 1							Змістовий модуль 2										
T1	T2	T3	T4	T5	T6	T7	T8	T9	T10	T11	T12	T13	T14	T15	T16	40	100
2	2,5	8	4	3	4	2	2	2	4	1,5	2,5	5	2,5	1,5	2,5		
Колоквіум							Колоквіум										
5							6										

Примітка. T1, T2 ... T12 – теми змістових модулів.

Максимальну кількість балів, яку може накопичити студент протягом тижня за формами та методами навчання, наведено в табл. 12.3.

Таблиця 12.3

Розподіл балів за тижнями

Теми змістового модуля		Лекційні заняття	Практичні заняття	Лабораторні заняття	Семінарські заняття	Диктант	Захист індивідуального завдання	Перевірка есе	Презентація	Експрес-опитування	Тестування	Письмова контрольна робота	Захист ІНДЗ	Колоквіум	Усього	
Змістовий модуль 1. Теоретичні та методологічні засади прийняття господарських рішень	Тема 1	1 тиждень	0,5	-	-	1	-	-	0,5	-	-	-	-	-	2,0	
	Тема 2	2 тиждень	0,5	0,5	-	-	-	1,5	-	-	-	-	-	-	2,5	
	Тема 3	3 тиждень	0,5	0,5	-	-	-	1,5	-	-	-	-	3	-	-	5,5
		4 тиждень	0,5	0,5	-	-	-	1,5	-	-	-	-	-	-	-	2,5
	Тема 4	5 тиждень	0,5	0,5	-	-	2	1	-	-	-	-	-	-	-	4,0
	Тема 5	6 тиждень	0,5	-	0,5	-	-	2	-	-	-	-	-	-	-	3,0
	Тема 6	7 тиждень	0,5	-	-	0,5	-	-	-	1	-	2	-	-	-	4,0
Тема 7	8 тиждень	0,5	-	-	-	-	1,5	-	-	-	-	-	-	5	7,0	
Змістовий модуль 2. Прийняття господарських рішень в умовах ризику	Тема 8	9 тиждень	0,5	0,5	-	-	-	1	-	-	-	-	-	-	2	
	Тема 9	10 тиждень	0,5	0,5	-	-	-	-	1	-	-	-	-	-	2	
	Тема 10	11 тиждень	0,5	0,5	-	-	-	-	1	-	-	2	-	-	4	
	Тема 11	12 тиждень	0,5	0,5	-	-	-	-	-	-	0,5	-	-	-	1,5	
	Тема 12	13 тиждень	0,5	0,5	-	-	-	1,5	-	-	-	-	-	-	2,5	
	Тема 13	14 тиждень	0,5	0,5	-	-	-	1	-	-	-	-	3	-	5	
	Тема 14	15 тиждень	0,5	0,5	-	-	-	1,5	-	-	-	-	-	-	2,5	
	Тема 15	16 тиждень	0,5	-	0,5	-	-	-	-	-	0,5	-	-	-	1,5	
	Тема 16	17 тиждень	0,5	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2	6	8,5
Усього		8,5	5,5	1	1,5	2	14	2	1,5	1	4	6	2	11	60	

Підсумкова оцінка з навчальної дисципліни визначається відповідно до Тимчасового положення "Про порядок оцінювання результатів

навчання студентів за накопичувальною бально-рейтинговою системою" ХНЕУ (табл. 12.4).

Оцінки за цією шкалою заносяться до відомостей обліку успішності, індивідуального навчального плану студента та іншої академічної документації.

Таблиця 12.4

Шкала оцінювання: національна та ЄКТС

Сума балів за всі види навчальної діяльності	Оцінка ЄКТС	Оцінка за національною шкалою	
		для екзамену, курсового проекту (роботи), практики	для заліку
90 – 100	A	відмінно	зараховано
82 – 89	B	добре	
74 – 81	C		
64 – 73	D		
60 – 63	E	задовільно	не зараховано
35 – 59	FX	незадовільно	
1 – 34	F		

13. Рекомендована література

13.1. Основна

1. Клименко С. М. Обґрунтування господарських рішень та оцінка ризиків : навч. посіб. / С. М. Клименко, О. С. Дуброва. – К. : КНЕУ, 2005. – 252 с.
2. Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків : навч. посіб. / Т. С. Клебанова, О. В. Мілов, С. В. Мілевський та ін. – Х. : Вид. ХНЕУ, 2010. – 262 с.
3. Пономаренко В. С. Прийняття управлінських рішень на підприємстві: процесний підхід : наукове видання / В. С. Пономаренко. – Х. : Вид. ХНЕУ, 2005. – 238 с.

13.2. Додаткова

4. Анісімова О. Неєфективні управлінські рішення /О. Анісімова // Фінансовий контроль. – 2011. – № 10. – С. 34–35.
5. Буянов В. Анализ рисков в деятельности предприятия / В. Буянов // Вопросы экономики. – 2004. – № 8. – С. 128–134.
6. Буянов В. П. Рискология : управление рисками : учеб. пособ. / В. П. Буянов. – 2-е изд., испр. и доп. – М. : Экзамен, 2003. – 382 с.
7. Вітлінський В. В. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком : навч.-метод. посіб. для самост. вивч. дисц. / В. В. Вітлінський, П. І. Верченко. – К. : КНЕУ, 2000. – 292 с.

8. Воробьев С. Н. Управленческие решения : учебник для вузов / С. Н. Воробьев. – М. : ЮНИТИ-ДАНА, 2003. – 317 с.
9. Воронкова А. Е. Управлінські рішення у забезпеченні конкурентоспроможності підприємства: організаційний аспект : монографія / А. Е. Воронкова ; Східноукр. нац. ун-т ім. Володимира Даля. – Х. : ВД "ІНЖЕК", 2008. – 511 с.
10. Воронцовский А. В. Управление рисками : учеб. пособ. / А. В. Воронцовский. – 2-е изд., испр. и доп. – СПб. : ОЦЭиМ, 2004. – 457 с.
11. Воротіна Л. І. Раціональні управлінські рішення як ресурс підвищення ефективності операційної діяльності підприємства / Л. І. Воротіна // Актуальні проблеми економіки. – 2012. – № 10. – С. 90–94.
12. Грешилов А. А. Математические методы принятия решений : учеб. пособ. для вузов / А. А. Грешилов. – М. : Изд. МГТУ им. Н. Э. Баумана, 2006. – 584 с.
13. Івченко І. Ю. Економічні ризики : навч. посіб. для вищ. навч. закл. / І. Ю. Івченко. – К. : Центр навчальної літератури, 2004. – 300 с.
14. Івченко І. Ю. Моделювання економічних ризиків і ризикових ситуацій : навч. посіб. / І. Ю. Івченко. – К. : Центр учбової літератури, 2007. – 344 с.
15. Ковальчук Н. П. Економічні ризики: класифікація, принципи і способи оцінювання / Н. П. Ковальчук // Актуальні проблеми економіки. – 2011. – № 10. – С. 31–37.
16. Козлов В. Н. Системный анализ, оптимизация и принятия решений : учеб. пособ. / В. Н. Козлов. – М. : Проспект, 2010. – 176 с.
17. Кречотун С. А. Обґрунтування господарських рішень у малому бізнесі / С. А. Кречотун // Економіка розвитку. – 2012. – № 3 (63). – С. 28–31.
18. Лук'янова В. В. Економічний ризик : навч. посіб. / В. В. Лук'янова, Т. В. Головач. – К. : Академвидав, 2007. – 464 с.
19. Маргасова В. Г. Фінансові ризики функціонування системи менеджменту акціонерних товариств / В. Г. Маргасова // Актуальні проблеми економіки. – 2010. – № 1. – С. 136–142.
20. Матвійчук А. В. Економічні ризики в інвестиційній діяльності : монографія / А. В. Матвійчук ; Вінниц. нац. техн. ун-т. – Вінниця : Універсум, 2005. – 202 с.
21. Моделі і методи соціально-економічного прогнозування: підручник / В. М. Геєць, Т. С. Клебанова, О. І. Черняк та ін. – 2-ге вид., випр. – Х. : ВД "ІНЖЕК", 2008. – 396 с.
22. Рысев Н. Правильные управленческие решения. Поиск и принятие / Н. Рысев. – 1-е изд., несовершен. – СПб. : Питер, 2004. – 380 с.
23. Тарасенко С. В. Ризики інвестиційної привабливості : монографія / С. В. Тарасенко. – Львів : Манускрипт, 2011. – 246 с.

24. Уткин Э. А. Управление рисками предприятия : учеб.-практ. пособ. / Э. А. Уткин. – М. : ТЕИС, 2003. – 247 с.

25. Хлістунова Н. В. Фінансові ризики і платоспроможність підприємств / Н. В. Хлістунова // Актуальні проблеми економіки. – 2003. – № 7. – С. 63–68.

26. Шапкин А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. – 7-е изд. – М. : Издательско-торговая корпорация "Дашков и К", 2009. – 544 с.

27. Юкаева В. С. Управленческие решения : учеб. пособ. / В. С. Юкаева. – М. : Дашков и К^о, 1999. – 291 с.

13.3. Інформаційні ресурси

28. Касьяненко В. О. Моделювання та прогнозування економічних процесів [Електронний ресурс] / В. О. Касьяненко. – Режим доступу : <http://sumdu.telesweet.net/doc/lections/Modelyuvannya-ta-prognozuvannya-ekonomichnih-protsesiv/index.html>.

29. Податковий кодекс України [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <http://minrd.gov.ua/nk>.

30. Регіони України : статистичний щорічник [Електронний ресурс]. – Режим доступу : www.ukrstat.gov.ua.

31. Сірік І. П. Методичні підходи до обґрунтування управлінських рішень [Електронний ресурс] / І. П. Сірік // Ефективна економіка. – Режим доступу : <http://www.economy.nayka.com.ua/index.php?operation=1&iid=623>.

32. Статистика України : науковий журнал [Електронний ресурс]. – Режим доступу : www.ukrstat.gov.ua.

33. Статистична звітність емітентів України [Електронний ресурс]. – Режим доступу : www.smida.gov.ua/db/emitent.

34. Экономика и управление на предприятиях : научно-образовательный портал. – Режим доступа : www.eur.ru.

13.4. Методичне забезпечення

35. Кулешова Н. В. Методичні рекомендації до виконання практичних завдань з навчальної дисципліни "Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків" [Електронний ресурс] / Н. В. Кулешова. – Режим доступу : <http://www.ikt.hneu.edu.ua/course/view.php?id=1754>.

36. Кулешова Н. В. Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків : опорний конспект [Електронний ресурс] / Н. В. Кулешова. – Режим доступу : <http://www.ikt.hneu.edu.ua/course/view.php?id=1754>.

37. Кулешова Н. В. Тестові завдання з навчальної дисципліни "Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків" [Електронний ресурс] / Н. В. Кулешова. – Режим доступу : <http://www.ikt.hneu.edu.ua/course/view.php?id=1754>.

Додатки

Додаток А
Таблиця А.1

Структура складових професійних компетентностей з навчальної дисципліни "Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків" за Національною рамкою кваліфікацій України

65

Складові компетентності, яка формується в рамках теми	Мінімальний досвід	Знання	Вміння	Комунікації	Автономність і відповідальність
1	2	3	4	5	6
Тема 1. Сутнісна характеристика господарських рішень					
Визначати способи формалізації й реалізації господарських рішень	Сутність поняття управлінських рішень та їх класифікація	Знання характеристик господарських рішень, основних форм їх вираження та реалізації; параметрів та умов забезпечення якості й ефективності господарських рішень	Ідентифікувати ключові проблеми на підприємстві	Ефективно формувати комунікаційну стратегію щодо розробки та реалізації господарських рішень	Відповідальність за точну ідентифікацію ключових проблем на підприємстві; розробку та реалізацію господарських рішень
Тема 2. Технологія прийняття рішень господарської діяльності					
Визначати технологію розробки та реалізації господарських рішень	Основні етапи прийняття управлінських рішень. Основні чинники прийняття управлінських рішень	Знання технології прийняття господарських рішень, змісту основних моделей та засобів прийняття рішень	Проводити декомпозицію економічної проблеми. Формувати пріоритети цілей та критеріїв прийняття рішення. Застосовувати метод Сааті з метою вибору найбільш ефективного господарського рішення	Презентувати результати визначення найбільш ефективного господарського рішення	Відповідальність за точність і коректність прийнятого рішення та строки його реалізації

1	2	3	4	5	6
Тема 3. Методичні основи підготовки господарських рішень					
Здійснювати обґрунтований вибір економіко-математичних методів та моделей для формування ефективних господарських рішень	Характеристика формалізованих та неформалізованих методів прийняття управлінських рішень	Знання методичних основ розробки та прийняття господарських рішень	Здійснювати вибір методичного інструментарю для вирішення конкретної економічної проблеми. Розробляти економіко-математичні моделі для розв'язання конкретної економічної проблеми	Презентувати результати побудови економіко-математичних моделей	Самостійно приймати ефективні управлінські рішення та відповідати за коректність і адекватність розроблених моделей
Тема 4. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання їх ефективності					
Формувати напрями підвищення ефективності господарських рішень	Чинники, що впливають на вибір методу обґрунтування господарських рішень	Знання критеріїв оцінки та принципів обґрунтування господарських рішень	Здійснювати обґрунтування господарських рішень з використанням економіко-математичних методів	Ефективно формувати комунікаційну стратегію	Приймати ефективні управлінські рішення та відповідати за надійність і точність результатів
Тема 5. Прогнозування та аналіз господарських рішень					
Прогнозувати господарські рішення з урахуванням впливу чинників зовнішнього середовища	Визначення прогнозування та його основних принципів	Знання основних етапів прогнозування; методів прогнозування та аналізу господарських рішень	Будувати прогнозні моделі результатів діяльності підприємства з урахуванням впливу зовнішнього середовища	Презентувати результати побудови прогнозних моделей	Самостійно приймати ефективні управлінські рішення щодо сценаріїв розвитку підприємства. Відповідати за коректність та адекватність розроблених моделей

1	2	3	4	5	6
Тема 6. Невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності					
Проводити аналіз впливу невизначеності на якість прийняття господарських рішень	Поняття невизначеності. Причини виникнення та види невизначеності	Знання формалізованих підходів до опису природи невизначеності	Визначати та формалізувати природу невизначеності. Визначати взаємозв'язок невизначеності та ризику. Здійснювати вибір математичного методу формалізації невизначеності	Презентувати результати формалізації невизначеності. Здатність до групової взаємодії в процесі з'ясування причин виникнення невизначеності	Приймати рішення в умовах невизначеності та відповідати за точність і коректність результатів
Тема 7. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності					
Визначати оптимальні господарські рішення в умовах невизначеності	Визначення поняття зовнішнього середовища та його станів. Поняття ймовірності та математичного очікування	Знання методичних основ розрахунку критеріїв оптимальності прийняття рішень	Обґрунтовувати господарські рішення в умовах невизначеності з використанням критеріїв Лапласа, Вальда, Севіджа, Гурвіца, оптимізму, песимізму	Презентувати результати побудови критеріїв оптимальності	Приймати ефективні управлінські рішення щодо розробки сценаріїв розвитку підприємства в умовах невизначеності
Тема 8. Теорія корисності та її застосування у процесах прийняття рішень					
Визначати схильність ОПР до ризику з використанням теорії корисності	Визначення корисності. Теорія графічної корисності	Знання основних властивостей, термінів та аксіом функції корисності; основних етапів побудови функції корисності; типових варіантів поведінки ОПР	Оцінювати премію за ризик. Визначати вид та параметри функції корисності. Розраховувати очікуваний вигравш, детермінований еквівалент та премію за ризик	Презентувати результати побудови функції корисності	Приймати рішення щодо схильності ОПР до ризику. Відповідальність за точність і коректність результатів

1	2	3	4	5	6
Тема 9. Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття господарських рішень					
Ідентифікувати підприємницькі ризики	Поняття підприємницького ризику. Принципові ознаки та класифікації підприємницьких ризиків	Знання принципів ознак ризику як економічної категорії, причин виникнення ризику та функцій його опису	Будувати дерево рішень виникнення можливих ризикових ситуацій	Ефективно формувати комунікаційну стратегію щодо розробки та реалізації господарських рішень в умовах ризику	Відповідальність за точність і коректність прийнятого рішення
Тема 10. Критерії прийняття господарських рішень за умов ризику					
Визначати оптимальні господарські рішення за умов ризику	Визначення поняття зовнішнього середовища та його станів. Поняття ймовірності та математичного очікування	Знання методичних основ розрахунку критеріїв оптимальності в умовах ризику	Обґрунтовувати вибір господарських рішень в умовах ризику на підставі критеріїв Байєса, Ходжена – Лемана)	Ефективно формувати комунікаційну стратегію щодо розробки та реалізації господарських рішень в умовах ризику	Відповідальність за точність і коректність прийнятого рішення
Тема 11. Прийняття рішень у конфліктних ситуаціях					
Визначати оптимальні господарські рішення в умовах конфлікту	Поняття "конфлікт" та "конфліктна ситуація". Основні поняття теорії гри	Знання методів знаходження оптимальної стратегії; принципу мінімаксу; чистих та змішаних стратегій гри	Використовувати елементи теорії гри в процесі визначення оптимального господарського рішення в умовах конфлікту	Ефективно формувати комунікаційну стратегію щодо розробки та реалізації господарських рішень в умовах конфлікту	Приймати ефективні управлінські рішення в умовах конфлікту
Тема 12. Обґрунтування фінансових та інвестиційних рішень за умов ризику					
Здійснювати оцінку ефективності портфелів цінних паперів з урахуванням ризику	Фінансові та інвестиційні рішення. Портфелі Г. Марковіца і Р. Гобіна	Знання критеріїв обґрунтування та прийняття інвестиційних рішень, теорії оптимального портфеля, особливостей формування оптимального портфеля з обмеженої кількості цінних паперів	Здійснювати оцінку ефективності портфелів цінних паперів. Визначати ступінь ризику портфеля. Здійснювати ранжування інвестиційних проектів за ступенем ризику	Презентувати результати визначення ступеня ризику	Управління комплексними діями щодо формування оптимального портфеля цінних паперів з урахуванням ризику

1	2	3	4	5	6
Тема 13. Якісне оцінювання підприємницьких ризиків					
Застосовувати методи експертних оцінок для визначення ступеня ризику	Поняття якісної оцінки. Методи експертного оцінювання	Розуміння якісного оцінювання ризику; знання методів якісного оцінювання	Визначати чинники ризику діяльності підприємства та їх рейтинги	Презентувати результати визначення якісної оцінки ступеня ризику	Відповідальність за точність і коректність результатів
Тема 14. Кількісне оцінювання підприємницьких ризиків					
Здійснювати оцінку абсолютного рівня ризику	Поняття кількісної оцінки. Основні поняття теорії ймовірності та математичної статистики	Знання кількісної оцінки підприємницьких ризиків, статистичного методу вимірювання ризику, змісту аналітичного методу оцінки ризику, методу аналогій	Визначати критичні значення ключових показників. Будувати криву ризику та визначати рівень втрат	Презентувати результати визначення кількісної оцінки ступеня ризику	Відповідальність за точність і коректність результатів
Тема 15. Основи ризик-менеджменту					
Визначати інтегральні показники оцінки ризику фінансово-господарської діяльності підприємства	Визначення поняття "управління". Системний та ситуаційні підходи до управління	Знання сутності ризик-менеджменту, основних принципів та функцій ризик-менеджменту; функцій об'єкта та суб'єкта управління	Визначати інтегральні показники ризику підприємства за видами його потенціалів. Будувати прогнози рівня ризику діяльності підприємства	Презентувати результати прогнозування рівня ризику діяльності підприємства	Відповідальність за точність і коректність результатів
Тема 16. Напрями і методи регулювання та зниження ступеня ризику					
Формувати напрями зниження ступеня ризику діяльності підприємства	Сутність процесу управління ризиками. Система показників ризиків	Знання основних напрямів та методів впливу на ступінь ризику, характеристики диверсифікації діяльності підприємства, моделі "ймовірність виникнення втрат/рівень збитків" для пошуку рішення щодо оптимізації ступеня ризику	Здійснювати оцінку вартості додаткової інформації про наявну проблему. Здійснювати хеджування валютного ризику	Презентувати результати зниження ступеня ризику	Приймати рішення у складних і непередбачуваних умовах, що потребує застосування нових підходів до оцінювання ризиків

Зміст

Вступ.....	3
1. Опис навчальної дисципліни.....	4
2. Мета та завдання навчальної дисципліни.....	5
3. Програма навчальної дисципліни.....	8
4. Структура навчальної дисципліни.....	14
5. Теми та плани семінарських занять.....	17
6. Теми практичних занять.....	18
6.1. Приклади типових практичних завдань за темами.....	21
7. Теми лабораторних занять.....	23
8. Самостійна робота.....	24
8.1. Індивідуальне науково-дослідне завдання.....	30
8.2. Контрольні запитання для самодіагностики.....	32
9. Індивідуально-консультативна робота.....	40
10. Методи навчання.....	40
11. Методи контролю.....	45
12. Розподіл балів, які отримують студенти.....	55
13. Рекомендована література.....	62
13.1. Основна.....	62
13.2. Додаткова.....	63
13.3. Інформаційні ресурси.....	64
13.4. Методичне забезпечення.....	65
Додатки.....	66

НАВЧАЛЬНЕ ВИДАННЯ

Робоча програма
навчальної дисципліни
**"ОБҐРУНТУВАННЯ ГОСПОДАРСЬКИХ
РІШЕНЬ І ОЦІНЮВАННЯ РИЗИКІВ"**

для студентів напряму підготовки
6.030504 "Економіка підприємства"

Укладачі: **Афанасьєв** Микола Васильович
Кулєшова Наталя Вадимівна

Відповідальний за випуск **Афанасьєв М. В.**

Редактор **Новицька О. С.**

Коректор **Новицька О. С.**

План 2014 р. Поз. № 173.

Підп. до друку Формат 60 x 90 1/16. Папір MultiCopy. Друк Riso.

Ум.-друк. арк. 4,5. Обл.-вид. арк. 5,63. Тираж прим. Зам. №

Видавець і виготівник – видавництво ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 61166, м. Харків, пр. Леніна, 9а

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