



Міністерство освіти і науки України
Харківський національний автомобільно-дорожній університет

“Затверджено”
Заступник ректора

Проф. І.П.Гладкий

“ ___ ” _____ 2012 р.

РОБОЧА НАВЧАЛЬНА ПРОГРАМА

з дисципліни: **«Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків»**

(за вимогами кредитно-модульної системи)

Робоча навчальна програма з дисципліни «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків» складена к.е.н., доцентом кафедри економіки підприємства Горовою К.О. на основі освітньо-професійної програми підготовки фахівців в галузі знань 0305 – «Економіка та підприємництво» за напрямом 6.030504 «Економіка підприємства».

Рецензент

доцент кафедри економіки підприємства,

к.е.н., доц.

Д.А. Горовий

Робоча навчальна програма розглянута на засіданні кафедри економіки підприємства (протокол № 1 від «28» серпня 2012 р.)

Завідувач кафедрою

економіки підприємства, д.е.н., проф.

І.А. Дмитрієв

Схвалено Радою (методичною комісією) ФУБ

Протокол № 1 від "28" серпня 2012р.

Голова Ради (методичної комісії)

факультету управління та бізнесу, д.е.н., проф.

І.А. Дмитрієв

«УЗГОДЖЕНО»

Зав. випускової кафедри

економіки підприємства, проф.

І.А. Дмитрієв

“ ___ ” _____ 2012 р.

1. Опис навчальної дисципліни

«Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків»

Система змістових модулів

Характеристика обсягів підготовки	Характеристика лекційного потоку	Характеристика навчального процесу
Загальний обсяг – 5 кредитів Усього годин – 180 Усього блоків змістових модулів - 5 Один блок змістових модулів 24 - 50 годин Усього змістових модулів – 21 Один змістовий мо- дуль 4 - 16 годин Всього аудиторних годин на тиждень – 3 години (1,5 години лекцій, 1,5 години практичних занять)	Галузь знань: 0305 «Еконо- міка та підприємництво» Напрямок підготовки 6.030504 «Економіка підприємства» Освітньо - кваліфікаційний рівень – бакалавр. Кількість навчальних груп в потоці – 5 Лектор, відповідальний за курс – к.е.н., доцент кафедри еко- номіки підприємства Горова Ксенія Олександрівна	Навчальний курс – циклу нормативних дисциплін підготовки бакалаврів Рік підготовки 3 - 4-й Семестр навчання 6-й та 7-й Кількість лекційних годин – 54 Практичні заняття, годин – 54 Самостійна робота, годин – 72 Модульний контроль (види контролю: тестові роботи) Підсумковий контроль (види контролю: 6-й семестр - інтегро- ваний залік, 7-й се- местр - інтегрований іспит)

Предметом навчальної дисципліни «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків» є господарські рішення та пов'язані з ними ризики на підприємстві.

2. Мета та завдання в галузі знань

Навчальна дисципліна «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків» відноситься до циклу нормативних дисциплін циклу професійної та практичної підготовки бакалаврів з галузі знань 0305 «Економіка та підприємництво» за напрямом підготовки 6.030504 «Економіка підприємства».

Метою викладання дисципліни є формування знань, вмінь та уявлень стосовно обґрунтування господарських рішень з різним ступенем невизначеності та ризику.

Згідно мети, основні завдання дисципліни полягають у наступному: засвоєння основних принципів обґрунтування різних видів господарських рішень, методичних підходів щодо аналізу ризику та управління ним; оволодіння навичками самостійно здійснювати аналіз, ідентифікацію та оцінювання ризику, використовуючи комп'ютерну техніку та програмно-математичні комплекси.

Після вивчення дисципліни майбутній фахівець повинен

Знати:

- Сутність та поняття господарських рішень;
- Основи технології прийняття господарських рішень;
- Методичні основи підготовки господарських рішень;
- Засоби обґрунтування господарських рішень та оцінювання їх ефективності;
- Методи прогнозування та аналізу господарських рішень;
- Поняття невизначеності;
- Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності
- Основи теорії корисності та можливості її застосування у процесах прийняття рішень;
- Види підприємницьких ризиків;
- Критерії прийняття господарських рішень за умов ризику;
- Механізм прийняття рішень у конфліктних ситуаціях;
- Методи обґрунтування фінансових та інвестиційних рішень за умов ризику;
- Засоби якісного оцінювання підприємницьких ризиків;
- Методи кількісного оцінювання підприємницьких ризиків;
- Основи та завдання ризик-менеджменту;
- Методи регулювання та зниження ступеня ризику.

Вміти:

- Виділити роль господарських рішень у підвищенні ефективності функціонування підприємства;
- Застосовувати різні способи формалізації господарських рішень;
- Застосовувати методи групового прийняття рішень;

- Приймати рішення в умовах невизначеності;
- Застосовувати різні математичні методи при розробці господарських рішень;
- Підготувати господарське рішення з використанням експертного методу;
- Обирати оптимальні методи і підходи до обґрунтування господарських рішень;
- Застосовувати методи лінійного програмування при прогнозуванні та аналізі господарських рішень;
- Обирати оптимальне використання ресурсу;
- Застосовувати методи обґрунтування рішень в умовах ризику та невизначеності;
- Застосовувати критерії Байєса, Лапласа, Вальда, Севіджа і Гурвіца при прийнятті рішення в умовах невизначеності;
- Оцінювати корисність доходу;
- Застосовувати теорію корисності при формуванні інвестиційної політики підприємства;
- Приймати господарське рішення в умовах підприємницького ризику;
- Складати розподіл ймовірностей та здійснювати розрахунок основних кількісних показників ризику;
- Застосовувати методи прийняття господарських рішень у конфліктних ситуаціях;
- Формувати портфель цінних паперів з різним ступенем ризику;
- Здійснювати оцінку підприємницького ризику експертним методом;
- Будувати дерево рішень для обґрунтування господарських рішень;
- Визначати ефективність страхування проекту;
- Визначати методи зниження підприємницького ризику.

Уявлення. В умовах економічної нестабільності, яка характерна для ринкового середовища, постійно виникає потреба у швидкому прийнятті науково обґрунтованих рішень щодо підвищення результативної діяльності суб'єктів господарювання. У даному контексті вагомим чинником формування базису таких рішень є серйозна фахова підготовка спеціалістів та керівників підприємств з урахуванням сучасної практики господарювання. Це обумовлює необхідність ознайомлення студентів з основними науково обґрунтованого прийняття рішень господарської діяльності, оцінювання ризиків підприємницької діяльності, визначення ступеня невизначеності навколишнього середовища. Проведення практичних занять та організація самостійної роботи студентів забезпечує формування необхідних вмінь та уявлень про теоретико-методичні засади обґрунтування господарських рішень підприємства, зокрема про застосування критеріїв прийняття рішень в умовах невизначеності.

ченості; прийняття рішень у конфліктних ситуаціях; оцінювання ризиків при прийнятті фінансових та інвестиційних рішень.

3. Зміст навчальної програми дисципліни

Вступ

Навчальна дисципліна «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків» читається для галузі знань 0305 - «Економіка та підприємництво», напрям 6.030504 «Економіка підприємства».

Загальний обсяг дисципліни становить 5 кредитів (180 годин), відповідно до чого структура дисципліни складається з наступних елементів: загальна кількість блоків змістових модулів – 5 (один блок змістових модулів – 24 - 50 год.); усього змістових модулів – 16 (один змістовий модуль – 5-10 год.).

Зміст дисципліни враховує знання студента попередніх предметів – «Економіка підприємства», «Статистика». У подальшому, отримані знання з дисципліни, будуть використані при вивченні фахових дисциплін: «Планування і контроль на підприємстві», «Математичне моделювання економіки», «Економічна діагностика», «Фінансовий менеджмент», «Стратегічне управління підприємством».

Для підготовки бакалаврів на рівні знань в програмі навчальної дисципліни передбачений цикл лекцій у їх сполученні з СРС.

В лекційному курсі викладення теоретичних матеріалів приводиться досить докладно, супроводжується доказом основних положень.

Формування рівня вмінь здійснюється з опорою на раніш отримані знання шляхом проведення практичних занять, відпрацьовуються рішення типових задач, видаються індивідуальні завдання для самостійної роботи.

Рівень уявлень студентів досягається у ході їх самостійної роботи з забезпеченням консультації викладача та СРС.

Модульний контроль здійснюється шляхом тестування.

Підсумковий контроль здійснюється шляхом розрахунку інтегрованої оцінки за підсумками модульного контролю.

Блок змістових модулів (розділ) №1.

Господарські рішення в різних сферах підприємницької діяльності.

Змістовий модуль 1. Сутнісна характеристика господарських рішень

Господарські рішення та їх види. Сутність та класифікація господарських рішень. Способи формалізації та реалізації господарських рішень. Якість і ефективність господарських рішень. Умови забезпечення якості господарського рішення. Види ефективності господарських рішень.

Змістовий модуль 2. Технологія прийняття рішень господарської діяльності

Процес прийняття господарських рішень. Елементи процесу прийняття рішень. Етапи та процедури процесу прийняття рішень. Основні моделі та засоби прийняття рішень. Характер та умови прийняття господарських рішень. Закони та закономірності, що впливають на прийняття рішень.

Змістовний модуль 3. Основні завдання для СРС за змістовими модулями 1-2

Умови та перешкоди прийняття ефективного рішення. Загальні закони управління людиною. Закон інерційності людських систем. Закони зв'язку із зовнішнім середовищем. Соціально-психологічні та біопсихічні закони.

Модульний *контроль* за змістовими модулями 1-3 (заліковий модуль №1) здійснюється у формі тестової роботи.

Блок змістових модулів (розділ) №2.

Методичні основи розробки та обґрунтування господарських рішень

Змістовий модуль 4. Методичні основи підготовки господарських рішень

Методи розробки господарських рішень. Аналітичні методи. Статистичні методи. Математичні методи. Методи експертних оцінок. Види експертних оцінок. Евристичні методи. Методи групової роботи. Методи індивідуальної роботи. Проведення ділових ігор. Метод сценаріїв.

Змістовий модуль 5. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання їх ефективності

Методи обґрунтування рішення. Вибір методів для обґрунтування конкретних господарських рішень. Критерії обґрунтування господарських рішень. Підходи до обґрунтування та вибору рішень. Математична теорія прийняття рішень. Якісно-предметна концепція (дескриптивний підхід).

Змістовий модуль 6. Прогнозування та аналіз господарських рішень

Мета та основні завдання прогнозування. Ключові принципи прогнозування господарських рішень. Джерела інформації для прогнозування. Сутність і принципи аналізу господарських рішень. Основні методи аналізу господарських рішень. Методи порівняння. Індексний метод. Балансовий метод. Графічний метод. Функціонально-вартісний аналіз. Матричні методи. Сфери застосування методів та інструментів прийняття господарських рішень.

Змістовний модуль 7. Основні завдання для СРС за змістовими модулями 4-6

Організаційно-діяльнісні ігри. Комплексна концепція рішень. Метод ланцюгових підстановок. Факторний аналіз.

Модульний контроль за змістовими модулями 4-7 (заліковий модуль №2) здійснюється у формі тестової роботи.

Блок змістових модулів (розділ) №3.

Прийняття господарських рішень в умовах невизначеності.

Змістовий модуль 8. Невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності

Сутність та види невизначеності. Основні причини невизначеності. Класифікація невизначеності. Види невизначеності за ступенем імовірності настання події. Види невизначеності за об'єктом невизначеності.

Змістовий модуль 9. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності

Застосування критеріїв Байєса, Лапласа, Вальда, Севіджа і Гурвіца при прийнятті рішення в умовах невизначеності. Вибір стратегії діяльності за допомогою критеріїв прийняття рішень. Побудова матриці прибутків.

Змістовий модуль 10. Теорія корисності та її застосування у процесах прийняття рішень

Проблема раціонального вибору. Поняття корисності. Функція корисності. Поняття лотереї. Умова несхильності до ризику, схильності до ризику, байдужості до ризику. Премія за ризик.

Змістовий модуль 11. Основні завдання для СРС за змістовими модулями 8-10

Чинники невизначеності. Засоби зниження невизначеності на практиці. Аксиоми раціональної поведінки. Математичне сподівання корисності.

Модульний контроль за змістовими модулями 8-11 (заліковий модуль №3) здійснюється у формі тестової роботи.

Блок змістових модулів (розділ) №4.

Прийняття господарських рішень з урахуванням підприємницьких ризиків.

Змістовий модуль 12 Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття господарських рішень

Характеристика ризику як економічної категорії. Класична та неокласична теорії ризику. Визначення понять ризик та господарський ризик. Функції ризику підприємницької діяльності. Класифікація підприємницьких ризиків.

Змістовий модуль 13. Критерії прийняття господарських рішень за умов ризику

Правило Байєса (критерій математичного сподівання), критерій середнього значення і стандартного відхилення, критерії Бернуллі, Лапласа, Гурвіца. Характеристика критеріїв обґрунтування господарських рішень в умовах ризику.

Змістовий модуль 14. Прийняття рішень у конфліктних ситуаціях

Поняття конфліктної ситуації. Теорія ігор. Складання платіжної матриці. Випадки оцінювання вибору. Мішана стратегія в теорії ігор. Межі застосування аналітичного інструментарію теорії ігор.

Змістовий модуль 15. Обґрунтування фінансових та інвестиційних рішень за умов ризику

Поняття інвестиційного рішення і інвестиційного проекту. Критерії обґрунтування рішень під час прийняття інвестиційного проекту. Визначення ставки дисконтування. Визначення середньозваженої ціни капіталу підприємства. Коефіцієнт β . Коефіцієнт систематичного ризику активу. Модель визначення ціни капітальних активів. Поняття фінансового рішення. Теорія оптимального портфелю.

Змістовий модуль 16. Основні завдання для СРС за змістовими модулями 12-15

Залежність прибутку від рівня ризику. Опціональний критерій прийняття рішень. Фактори впливу на ступінь підприємницького ризику. Ефективність інвестиційного проекту.

Модульний контроль за змістовими модулями 12-16 (заліковий модуль №4) здійснюється у формі тестової роботи.

Блок змістових модулів (розділ) №5.

Оцінювання та управління ризиками підприємницької діяльності

Змістовий модуль 17. Якісне оцінювання підприємницьких ризиків

Сутність якісного аналізу підприємницьких ризиків. Класифікація зон ризику: зона допустимого ризику, зона критичного ризику, зона катастрофічного ризику. Вивчення причин появи зовнішніх і внутрішніх ризиків. Класифікаційна система ризиків.

Змістовий модуль 18. Кількісне оцінювання підприємницьких ризиків

Ступінь ризику. Оцінка імовірності появи втрат і величини втрат. Імовірні втрати в процесі здійснення підприємницької діяльності. Система показників абсолютного та відносного вимірювання ризику. Побудова кривої ризику. Методи кількісного оцінювання підприємницьких ризиків.

Змістовий модуль 19. Основи ризик-менеджменту

Поняття ризик-менеджменту. Ризик-менеджмент як система управління. Стратегія та тактика ризик-менеджменту. Процес управління ризиками господарської діяльності на підприємстві.

Змістовий модуль 20. Напрями і методи регулювання та зниження ступеня ризику

Напрями та методи впливу на ступінь ризику господарювання. Компенсація ризику. Збереження ризику. Передача ризику. Методи зниження ступеня ризику.

Змістовий модуль 21. Основні завдання для СРС за змістовими модулями 17-20

Імітаційне моделювання інвестиційних ризиків. Показники аналізу вартіабельності прибутку. Методи оцінки ризикованості інвестиційних проектів. Застосування диверсифікації для зниження ступеня ризику господарської діяльності.

Модульний контроль за змістовими модулями 17-21 (заліковий модуль №4) здійснюється у формі тестової роботи.

Заключення

Особливості вивчення дисципліни «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків» визначаються завданнями й функціями цієї сфери діяльності підприємств і фірм в умовах ринкової економіки. Знання й уміння, отримані в результаті вивчення навчального курсу будуть використовуватися в подальшому при вивченні дисципліни «Планування діяльності підприємства». Актуальність вивчення дисципліни «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків» обумовлена необхідністю підготовки фахівців до планування, організації й здійснення самостійної науково-методичної роботи з прийняття рішень у процесі господарської діяльності.

4 Розподіл тем занять (за годинами та кредитами)

Перелік та назви змістовних модулів	Загалом на змістовий модуль, год/кредит	Лекцій	Прак. робіт	СРС
Блок змістових модулів №1 Господарські рішення в різних сферах підприємницької діяльності				
Змістовий модуль 1. Сутнісна характеристика господарських рішень	16 / 0,44	4	8	4
Змістовий модуль 2. Технологія прийняття рішень господарської діяльності	16 / 0,44	4	8	4
Змістовний модуль 3. Основні завдання для СРС	8 / 0,22	-	-	8
Блок змістових модулів №2 Методичні основи розробки та обґрунтування господарських рішень				
Змістовий модуль 4. Методичні основи підготовки господарських рішень	16 / 0,44	4	8	4
Змістовий модуль 5. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання їх ефективності	10 / 0,28	2	4	4
Змістовий модуль 6. Прогнозування та аналіз господарських рішень	16 / 0,44	4	8	4
Змістовний модуль 7. Основні завдання для СРС	8 / 0,22	-	-	8
Інтегрований залік				
Блок змістових модулів №3 Прийняття господарських рішень в умовах невизначеності				
Змістовий модуль 8. Невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності	4 / 0,11	2	-	2
Змістовий модуль 9. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності	8 / 0,22	4	2	2
Змістовий модуль 10. Теорія корисності та її застосування у процесах прийняття рішень	8 / 0,22	4	2	2
Змістовний модуль 11. Основні завдання для СРС	4 / 0,11	-	-	4
Блок змістових модулів №4 Прийняття господарських рішень з урахуванням підприємницьких ризиків				
Змістовий модуль 12. Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття господарських рішень	6 / 0,17	2	2	2
Змістовий модуль 13. Критерії прийняття господарських рішень за умов ризику	8 / 0,22	4	2	2

Перелік та назви змістовних модулів	Загалом на змістовий модуль, год/кредит	Лекцій	Прак. робіт	СРС
Змістовий модуль 14. Прийняття рішень у конфліктних ситуаціях	8 / 0,22	4	2	2
Змістовий модуль 15. Обґрунтування фінансових та інвестиційних рішень за умов ризику	8 / 0,22	4	2	2
Змістовний модуль 16. Основні завдання для СРС	4 / 0,11			4
Блок змістових модулів №5 Оцінювання та управління ризиками підприємницької діяльності				
Змістовий модуль 17. Якісне оцінювання підприємницьких ризиків	4 / 0,11	2	-	2
Змістовий модуль 18. Кількісне оцінювання підприємницьких ризиків	8 / 0,22	4	2	2
Змістовий модуль 19. Основи ризик-менеджменту	6 / 0,17	2	2	2
Змістовий модуль 20. Напрями і методи регулювання та зниження ступеня ризику	8 / 0,22	4	2	2
Змістовний модуль 21. Основні завдання для СРС	6 / 0,17	-	-	6
Інтегрований іспит				
ЗАГАЛОМ	180 / 5	54	54	72

5 Система оцінювання навчання студента (залікові модулі)

Зміст навчального матеріалу	Кількість годин	Обсяг трудовитрат студента (кредитів)	Форма контролю	Шкала оцінювання знань студента (бали)
Перший заліковий модуль за змістовими модулями 1 - 3	40	1,11	Модульні тестові роботи	(1...100)
Другий заліковий модуль за змістовими модулями 4 - 7	50	1,39	Модульні тестові роботи	(1...100)
Інтегрований залік				(1...100)
Третій заліковий модуль за змістовими модулями 8 -11	24	0,67	Модульні тестові роботи	(1...100)
Четвертий заліковий модуль за змістовими модулями 12 - 16	34	0,94	Модульні тестові роботи	(1...100)
П'ятий заліковий модуль за змістовими модулями 17 - 21	32	0,89	Модульні тестові роботи	(1...100)
Інтегрований іспит				(1...100)
ЗАГАЛОМ	180	5		

6 Види, форми та методи навчання

Лекції, практичні заняття, консультації, самостійна робота студентів згідно табл. 4 «Розподіл змістових модулів», табл. 6 Тематика (план) практичних занять.

Номер практичної роботи	Назва практичних занять	Кількість годин	Обсяг навчального матеріалу (кредити)
1	Роль господарських рішень у підвищенні ефективності функціонування суб'єктів економічної діяльності	2	0,055
2	Розгляд способів формалізації та реалізації господарських рішень	2	0,055
3	Групове прийняття рішень	2	0,055
4	Прийняття рішень в умовах невизначеності	2	0,055
5	Застосування математичних методів при розробці господарських рішень	2	0,055
6	Застосування експертного методу при підготовці господарських рішень	2	0,055
7	Вибір оптимальних методів і підходів до обґрунтування господарських рішень	2	0,055
8	Цілочисельне лінійне програмування	2	0,055
9	Вибір оптимального використання ресурсу	2	0,055
10, 11	Обґрунтування рішень в умовах ризику та невизначеності	4	0,111
12, 13	Застосування критеріїв Байєса, Лапласа, Вальда, Севіджа і Гурвіца при прийнятті рішення в умовах невизначеності	4	0,111
14,15	Оцінювання корисності доходу	4	0,111
16, 17	Застосування теорії корисності при формуванні інвестиційної політики підприємства	4	0,111
18	Прийняття господарського рішення в умовах ризику	2	0,055
19	Складання розподілу ймовірностей та розрахунок основних кількісних показників ризик	2	0,055
20	Прийняття господарських рішень у конфліктних ситуаціях	2	0,055
21	Формування портфелю цінних паперів з різним ступенем ризику	2	0,055
22, 23	Оцінка підприємницького ризику експертним методом	4	0,111
24	Обґрунтування господарських рішень за допомогою побудови дерева рішень	2	0,055
25	Визначення ефективності страхування проекту	2	0,055
26, 27	Визначення методів зниження підприємницького ризику	4	0,111
ЗАГАЛОМ		54	1,5

7 Система оцінки знань студентів і шкала оцінок*

Оцінка в балах	Оцінка за нац. шкалою	Оцінка за шкалою ECTS	
		Оцінка	Критерії
90-100	Відмінно	A	"Відмінно" - теоретичний зміст курсу освоєний цілком , без прогалин, необхідні практичні навички роботи з освоєним матеріалом сформовані, усі передбачені програмою навчання навчальні завдання виконані , якість їхнього виконання оцінено числом балів, близьким до максимального
80-89	Добре	B	"Дуже добре" - теоретичний зміст курсу освоєний цілком , без прогалин, необхідні практичні навички роботи з освоєним матеріалом в основному сформовані, усі передбачені програмою навчання навчальні завдання виконані , якість виконання більшості з них оцінено числом балів, близьким до максимального
75-79		C	"Добре" - теоретичний зміст курсу освоєний цілком , без прогалин, деякі практичні навички роботи з освоєним матеріалом сформовані недостатньо , усі передбачені програмою навчання навчальні завдання виконані якість виконання жодного з них не оцінено мінімальним числом балів, деякі види завдань виконані з помилками
67-74	Задовільно	D	"Задовільно" - теоретичний зміст курсу освоєний частково , але прогалини не несуть істотного характеру, необхідні практичні навички роботи з освоєним матеріалом в основному сформовані, більшість передбачених програмою навчання навчальних завдань виконано , деякі з виконаних завдань, можливо, містять помилки
60-66		E	"Посередньо" - теоретичний зміст курсу освоєний частково , деякі практичні навички роботи не сформовані , багато передбачені програмою навчання навчальні завдання не виконані , або якість виконання деяких з них оцінено числом балів, близьким до мінімального
35-59	Незадовільно	FX	"Умовно незадовільно" - теоретичний зміст курсу освоєний частково , необхідні практичні навички роботи не сформовані , більшість передбачених програм навчання навчальних завдань не виконано , або якість їхнього виконання оцінено числом балів, близьким до мінімального ; при додатковій самостійній роботі над матеріалом курсу можливе підвищення якості виконання навчальних завдань (з можливістю повторного складання)
1-34		F	"Безумовно незадовільно" - теоретичний зміст курсу не освоєно , необхідні практичні навички роботи не сформовані , усі виконані навчальні завдання містять грубі помилки , додаткова самостійна робота над матеріалом курсу не приведе до якого-небудь значимого підвищення якості виконання навчальних завдань (з обов'язковим повторним курсом).

*Примітка. Згідно з наказом МОН України від 30.12.05 р. № 774 підсумкова оцінка знань з навчальної дисципліни визначається як середньозважена результ-

татів засвоєння окремих залікових модулів в інтервалі (1... 100) балів. Розрахунок здійснюється за формулою

$$B_{д} = \alpha_1 \cdot B_1 + \alpha_2 \cdot B_2 + \dots + \alpha_n \cdot B_n,$$

де B_i – кількість балів за рівень знань студента i -го залікового модуля;
 α_i - коефіцієнт вагомості кожного залікового модуля.

Підсумкова оцінка трудовитрат студента за освоєння змісту навчальної дисципліни $K_{д}$ визначається як арифметична сума кредитів за всіма заліковими модулями, що засвоєні (K_i):

$$K_{д} = \sum_{i=1}^N K_i,$$

де $i = 1 \dots N$ - кількість залікових модулів;

K_i - трудовитрати (в кредитах) на засвоєння залікового модуля.

8 Методичне забезпечення

1. Робоча навчальна програма з дисципліни: «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків» (за вимогами кредитно-модульної системи)

2. Робочий план з дисципліни «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків»

3. Методичні вказівки до практичних занять студентів з дисципліни «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків»

4. Методичні вказівки до самостійної роботи студентів з дисципліни «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків»

5. Конспект лекцій з дисципліни «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків»

9 Література, рекомендована для самостійної роботи студентів

Основна література

1. Борисова Г.М. Теоретичні аспекти управління ризиком на підприємстві / Г.М. Борисова // Актуальні проблеми економіки. – 2005. - №7. – С.116-121.
2. Боровкова В.А. Управление рисками в торговле / В.А. Боровкова. – СПб.: Питер, 2004. – 288 с., илл. (23,22 п.л.).
3. Боровкова В.А., Мокин В.Н., Мурашова С.В. Финансы и кредит : [учебник для вузов с грифом УМО] / В.А. Боровкова, В.Н. Мокин, С.В. Мурашова. – СПб.: Бизнес-Пресса, 2006. – 672 с.
4. Василенко В.А. Теорія і практика розробки управлінських рішень: Навчальний посібник. К.: ЦУЛ, 2003. - 420с.
5. Вербицька Г.Л. Управління економічним ризиком / Г.Л. Вербицька // Фінанси України. – 2004. - № 4. - С. 34-40.
6. Виленский П.Л., Ливши В.Н., Орлова Е.Р., Смоляк С.А. Оценка эффективности инвестиционных проектов / П.Л. Виленский, В.Н. Ливши, Е.Р. Орлова, С.А. Смоляк. – [2-е изд., перераб. и доп.]. - М.: Дело, 2002. — 888 с.
7. Вітлінський В.В., Великоіваненко Г.І. Ризикологія в економіці та підприємстві: [монографія] / Вітлінський В.В., Великоіваненко Г.І.. – К.: КНЕУ, 2004. - 245 с.
8. Давыдова Г.В., Беликов А.Ю. Методика количественной оценки риска банкротства предприятий / Г.В. Давыдова, А.Ю. Беликов // Управление риском. -№ 3.- 2005. - С. 13-20.
9. Донець Л.І. Економічні ризики та методи їх вимірювання : [навч. посібник] / Л.І. Донець.-К.:ЦУЛ, 2006.- 312 с.
10. Івченко І.Ю. Моделювання економічних ризиків і ризикових ситуацій : [навч. посіб.] / І.Ю. Івченко. – К.: Центр учбової літератури, 2007. – 344 с.
11. Камінський А.Б. Економічний ризик та методи його вимірювання / А.Б. Камінський. – К.: Козаки, 2002.-120с.
12. Клименко С.М. Обґрунтування господарських рішень і оцінка ризиків: [навч. посіб. для самостійного вивчення дисципліни.] /С.М.Клименко, О.С.Дуброва.- К.: КНЕУ, 2006.- 188 с.
13. Кравченко В. Розробка сучасного стандарту з управління ризиками – важливий чинник підвищення ефективності підприємницької діяльності в Україні / Володимир Кравченко // Теоретичні та прикладні питання економіки : [зб. наук. пр.]. – К.: Видавничо-поліграфічний центр “Київський університет”, 2008. – Вип. 17. – 330 с. - с. 159 – 166.
14. Лук’янова В.В. Економічний ризик : [навч. посіб.]. / В.В. Лук’янова, Т.В. Головач. – К.: ВЦ "Академія", 2007. – 345 с.
15. Машина Н.І. Економічний ризик та методи його вимірювання : [навч. посібник] / Н.І. Машина. - К.: Центр навчальної літератури, 2003. - 188с.

16. Пасічник В.Г., Аніліна О.В. Економічне обґрунтування господарських рішень.- К.: Центр навчальної літератури, 2005.-144с.

17. Сулим М. В. Економічний ризик та методи його вимірювання: навч. посіб. / М.В. Сулим. – Л.: вид-во Львів. комерц. акад., 2003. – 196 с.

18. Хохлов Н.В. Управление риском / Н.В. Хохлов.- М.: ЮНИТИ, 2001.-239с.

19. Чернова Г. В. Практика управления рисками на уровне предприятия : [учебное пособие] / Г.В.Чернова. – СПб: Ин-т страхования, 2000. – 170 с.

20. Шапкин А.С. Экономические и финансовые риски: оценка, управление, портфель инвестиций / А.С. Шапкин. – [2-е изд.]. – М.: Дашков и К, 2003. – 543 с.

Додаткова література

Блок змістовних модулів №1

1. Алексеев Л.В. Анализ и обоснование хозяйственных решений. - М.:Финансы и статистика, 1991. - 133 с.

2. Аленичев В. В. Страхование валютных рисков, банковских и экспортных коммерческих кредитов : [учеб. пособие] / В.В. Аленичев. – М.: ИСТ–Сервис, 1994. –212 с.

3. Балабанов И.Т. Риск-менеджмент : [монография] / И.Т. Балабанов. - М.: Финансы и статистика, 1996. - 188 с.

4. Бендиков М.А. Экономическая безопасность промышленного предприятия условиях кризисного развития / М.А. Бендиков // Менеджмент в России и за рубежом. – 2000. - № 2.

5. Берестнева О.Г., Муратова Е.А. Построение логических моделей с использованием деревьев решений / О.Г. Берестнева, Е.А. Муратова // Известия Томского политехнического университета. - 2004. - Т. 307. - № 2 – С.154-160.

Блок змістовних модулів №2

1. Ван Хорн, Джеймс, К., Вахович, мл., Джон, М. Основы финансового менеджмента, 11-е издание: Пер. с англ. - М.: Издательский дом «Вильямс», 2003.-992 с.

2. Вишняков Я. Д., Колосов А.В., Шемякин В.Л. Оценка и анализ финансовых рисков предприятия в условиях враждебной окружающей среды бизнеса / Я.Д. Вишняков, А.В. Колосов, В.Л. Шемякин. –№3.-2000-С. 15-17.

3. Вітлінський В.В., Наконечний С. І. Ризик у менеджменті: [підручник] / Вітлінський В. В., Наконечний С. І.. – К. : ТОВ “Боирсфен-М”, 1996. - 112с.

4. Грабовой П.Г. Риски в современном бизнесе / П.Г. Грабовой. – М.: Аланс, 1994. - 240 с.

Блок змістовних модулів №3

1. Гранатуров В.М. Экономический риск: сущность, методы измерения, пути снижения : [учебн. пособие] / В.М. Гранатуров. – [2-е изд.]. – М.: Изд. “Дело и сервис”, 2002. – 160 с.
2. Колпаков В.М. Теорія і практика прийняття управлінських рішень: Навчальний посібник. К.: МАУП, 2001. - 253с.
3. Лапуста М. Г. Риски в предпринимательской деятельности: [учеб. пособие] / М. Г. Лапуста, Л. Г. Шаршукова и др. – М.: ИНФРА-М, 2003. – 223 с.

Блок змістовних модулів №4

1. Лігоненко Л.О. Антикризове управління підприємством: теоретико-методологічні засади та практичний інструментарій : [монографія] / Лариса Олександрівна Лігоненко. - К.: КНТЕУ, 2001.- 580 с.
2. Недосекин А.О., Павлов К.Е., Абдулаева З.И. Стратегический подход к управлению рисками корпорации // Стратегический менеджмент,-2008-№4.
3. Норткотт Д. Принятие инвестиционных решений: Пер. с англ./ Под ред. А.Н.Шохина.- М.: Банки и биржи, ЮНИТИ, 1997.- 247 с.
4. Ризик у ринковій економіці: навчальний посібник / Андреева Г.Є., Петровська Г.Е. – Харків: Бурун Книга, 2005

Блок змістовних модулів №5

1. Романов В. С. Понятие рисков и их классификация как основной элемент теории рисков / В.С. Романов // Инвестиции в России. — 2000. — № 12. - С. 41—43.
2. Рэдхэд К. Управление финансовыми рисками / К. Рэдхэд, С. Хьюс; [пер. с англ.]. – М.:ИНФРА-М, 1996. – 287 с. - (ПБ Профессиональная библиотека Серия "Финансы").
3. Садеков А.А., Цурик В.В. Управление предприятием в условиях кризиса: Монография. – Донецк: ДонГУЭТ, 2006. – 178 с.
4. Смирнов З.А. Управленческие решения. М.: ИНФРА-М, 2001.- 192 с.

Розробив доцент кафедри
економки підприємства

Горова К.О.