

ПрАТ «ВНЗ «МІЖРЕГІОНАЛЬНА
АКАДЕМІЯ УПРАВЛІННЯ ПЕРСОНАЛОМ»



НАВЧАЛЬНА ПРОГРАМА

дисципліни

**«ОБГРУНТУВАННЯ ГОСПОДАРСЬКИХ РІШЕНЬ І
ОЦІНЮВАННЯ РИЗИКІВ»**

(для бакалаврів)

МАУП - 2018

Підготовлено професором кафедри економіки і управління підприємством,
В.Є. Сафоновою

Затверджено на засіданні кафедри економіки і управління підприємством
(протокол №2 від 20.09.2018)

*Схвалено Вченою радою Навчально-наукового Інституту менеджменту,
економіки та фінансів (протокол №9 від 22.10.2018р.)*

Сафонова В.Є. Навчальна програма дисципліни «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків» (для бакалаврів). – К.: МАУП, 2018. – 23 с.

Навчальна програма містить пояснювальну записку, тематичний план, зміст дисципліни «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків», питання для самоконтролю, а також список літератури.

Міжрегіональна Академія
управління персоналом (МАУП),
2018

ПОЯСНЮВАЛЬНА ЗАПИСКА

Дисципліна «**Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків**» направлена на вивчення таких питань, як сутнісна характеристика господарських рішень, способи формалізації та реалізації господарських рішень, особливості їх прийняття, методичні основи розроблення та обґрунтування господарських рішень, зміст, мета та принципи економічного обґрунтування господарських рішень, невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності, обґрунтування господарських рішень в умовах невизначеності та їх характеристика, теорія корисності в системі процесів прийняття рішень, підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття господарських рішень і оцінювання, основні підходи щодо управління ризиком та ін.

Вивчення даної дисципліни є необхідною та важливою умовою формування професійних знань і навичок для фахівців даного напрямку підготовки, відповідає завданням підготовки фахівців у вищих навчальних закладах, сприяє здобуттю ними знань, необхідних в умовах постійного виникнення потреби у швидкому прийнятті науково обґрунтованих рішень щодо підвищення результативної діяльності суб'єктів господарювання та підкріпленні переконливими доказами відповідності передбачуваного рішення заданим критеріям і реальним обмеженням. Ці знання відповідають завданням підготовки фахівців у вищих навчальних закладах, вивчення дисципліни сприяє здобуттю необхідного обсягу та рівня загальних знань в галузі економіки та підприємництва.

Вивчення цього курсу ув'язано зі змістом таких дисциплін як «Економіка підприємства», «Планування і контроль на підприємстві», «Стратегія підприємства», «Менеджмент», «Фінанси».

Мета навчальної дисципліни — ознайомити слухачів з технологією прийняття рішень, основами сучасної економічної ризикології та на основі набутої систематизованої інформації сформувати комплексну систему знань і

практичних навичок щодо обґрунтування господарських рішень із різним ступенем невизначеності та ризику.

Завданнями вивчення дисципліни є оволодіння теоретичними знаннями і практичними навичками в області обґрунтування господарських рішень, засвоєння основних принципів обґрунтування різних видів господарських рішень, вивчення послідовності проведення економічного обґрунтування будь-яких господарських рішень, методичних підходів щодо аналізу та управління ризиками, засвоєння математичного апарата, необхідного для обґрунтування господарських рішень та оцінювання ризиків. Студенти повинні вміти застосовувати отримані знання на практиці, самостійно проводити обґрунтування господарських рішень, використовуючи різні методи та підходи для цього.

Після вивчення курсу «Обґрунтування господарських рішень та оцінка ризиків» студенти повинні **знати**:

- основні поняття й категорії обґрунтування господарських рішень та оцінки підприємницьких ризиків;
- сучасні методи й моделі розроблення, обґрунтування та прийняття господарських рішень;
- основні принципи й підходи до обґрунтування господарських рішень в умовах невизначеності та ризику;
- методичні основи кількісного та якісного аналізу підприємницьких ризиків;
- теоретичні аспекти ризик-менеджменту та напрями регулювання підприємницьких ризиків.

Після вивчення курсу «Обґрунтування господарських рішень та оцінка ризику» студенти повинні **вміти**:

- визначати оптимальні форми подання та реалізації господарських рішень;

• розробляти й обґрунтовувати господарські рішення на основі комплексу методів і моделей, системи показників економічного обґрунтування рішень;

• обґрунтовувати вибір оптимального господарського рішення в умовах невизначеності та ризику;

• аналізувати ефективність інвестиційних і фінансових рішень;

• здійснювати ідентифікацію, аналіз та оцінювання ризику, використовуючи комп'ютерну техніку та програмно-математичні комплекси;

• визначати напрями та методи регулювання господарських ризиків на підприємстві.

Досягненню мети й вирішенню завдань курсу підпорядкована логіка його викладання, яка наведена в навчально-тематичному плані. Програмні теми дисципліни є обов'язковими для вивчення кожним студентом незалежно від форми навчання.

ТЕМАТИЧНИЙ ПЛАН
дисципліни
«ОБґРУНТУВАННЯ ГОСПОДАРСЬКИХ РІШЕНЬ І
ОЦІНЮВАННЯ РИЗИКІВ»

№ пор.	Назва змістового модуля і теми
1	2
	Змістовий модуль 1. Господарські рішення в різних сферах підприємницької діяльності
1	Сутнісна характеристика господарських рішень
2	Особливості прийняття рішень господарської діяльності
3	Методичні основи розроблення та обґрунтування господарських рішень
	Змістовий модуль 2. Ризик і невизначеність під час обґрунтування господарських рішень
4	Невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності
5	Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття господарських

	рішень
6	Обґрунтування інвестиційних і фінансових рішень
7	Оцінювання підприємницьких ризиків
8	Основи ризик-менеджменту
9	Конкурентна стратегія розвитку України в умовах глобалізації
Разом годин: 120	

ЗМІСТ
дисципліни
«ОБГРУНТУВАННЯ ГОСПОДАРСЬКИХ РІШЕНЬ І
ОЦІНЮВАННЯ РИЗИКІВ»

Змістовий модуль 1. Господарські рішення в різних сферах підприємницької діяльності

Тема 1. Сутнісна характеристика господарських рішень

Поняття господарських рішень та їхні ознаки. Сутність господарських рішень. Класифікація господарських рішень. Вимоги до господарських рішень та умови їх досягнення.

Способи формалізації та реалізації господарських рішень. Визначення оптимальних форм подання та реалізації господарських рішень.

Якість та ефективність господарських рішень. Основні параметри та показники якісного рішення. Умови забезпечення якості господарського рішення. Види ефективності господарських рішень. Умови та перешкоди прийняття ефективного рішення. Принципи оцінювання ефективності господарських рішень.

Література [1 – 7; 8; 9; 11; 22]

Тема 2. Особливості прийняття рішень господарської діяльності

Необхідність прийняття господарських рішень. Процес прийняття рішень та його елементи. Етапи та процедури процесу прийняття рішень. Стилі прийняття рішень. Основні способи прийняття рішень.

Корисні структурні схеми для прийняття рішень. Методи, що

використовуються для формалізації моделей прийняття господарських рішень.

Характер прийняття господарських рішень. Класична, поведінкова та ірраціональна моделі прийняття рішень. Основні чинники, що впливають на прийняття рішення. Умови прийняття господарських рішень залежно від ступеня визначеності інформації. Ранжирування умов прийняття рішень. Контроль за процесом виконання господарських рішень. Характеристика видів контролю.

Закони й закономірності, що впливають на прийняття рішень. Загальні закони управління людиною. Закон інерційності людських систем. Закони зв'язку з зовнішнім середовищем. Соціально-психологічні та біопсихічні закони.

Література [1 – 7; 8-19; 24, 27, 28]

Тема 3. Методичні основи розроблення та обґрунтування господарських рішень

Методи розроблення господарських рішень. Аналітичні, статистичні та математичні методи. Експертні методи та межі їх застосування. Види експертних оцінок. Сутність евристичного програмування та його різновиди. Евристичні методи групової та індивідуальної роботи. Ділові й організаційно-діяльнісні ігри. Метод сценаріїв. Сутність і види методу «дерево цілей».

Обґрунтування господарських рішень. Методичні основи обґрунтування господарських рішень. Підходи до обґрунтування й вибору господарських рішень. Комплексний підхід до обґрунтування господарських рішень.

Прогнозування та аналіз господарських рішень. Основні завдання прогнозування. Головні принципи прогнозування господарських рішень. Сутність та принципи аналізу господарських рішень. Методи аналізу господарських рішень та їхній інструментарій. Сфери застосування методів та інструментів прийняття

господарських рішень.

Література [1 – 7; 8-14; 19; 22; 24;28]

Змістовий модуль 2. Ризик і невизначеність під час обґрунтування господарських рішень

Тема 4. Невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності

Особливості функціонування підприємств за умов невизначеності. Сутність невизначеності та основні причини її появи. Видова класифікація невизначеності. Урахування чинника невизначеності в управлінні підприємством і засоби її зниження.

Критерії (правила) обґрунтування господарських рішень в умовах невизначеності та їхня характеристика. Матриця прибутків і матриця витрат, особливості їхньої побудови.

Теорія корисності в системі процесів прийняття рішень. Аксиоми раціональної поведінки. Лотерея, її детермінований еквівалент, премія за ризик та страхова сума. Умови схильності, несхильності, байдужості до ризику. Приклади функцій корисності. Методика побудови функції корисності.

Література [1 – 7; 8-16; 19-25; 26; 28]

Тема 5. Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття господарських рішень

Ризик у діяльності суб'єкта господарювання. Сутнісна характеристика ризику. Ризик як економічна категорія. Ризик і невизначеність. Основні риси підприємницького ризику. Чинники впливу на ступінь ризику. Функції ризику в підприємницькій діяльності.

Класифікація підприємницьких ризиків. Характеристика підприємницьких

ризиків за сферою їхнього походження та ступенем впливу на результати діяльності підприємств.

Обґрунтування господарських рішень в умовах ризику. Характеристика критеріїв прийняття рішень за умов ризику.

Особливості прийняття рішень у конфліктних ситуаціях. Сутність теорії ігор. Система понять теорії ігор. Чиста та змішана стратегії.

Література [1 – 7; 8-12; 16-19; 23-27]

Тема 6. Обґрунтування інвестиційних і фінансових рішень

Інвестиційні рішення та критерій ефективності їх прийняття. Критерії обґрунтування рішень під час прийняття (вибору) інвестиційного проекту.

Врахування ризику при обґрунтуванні ставки дисконтування. Коефіцієнт систематичного ризику. Опціональний критерій прийняття рішень. Систематичний ризик і очікувана дохідність компанії.

Сутність фінансових рішень. Портфелі Г. Марковіца і Р. Гобіна. Теорія оптимального портфеля. Формування оптимального портфеля з обмеженої кількості цінних паперів.

Література [1 – 7; 8-17; 21; 24-28]

Тема 7. Оцінювання підприємницьких ризиків

Сутність кількісного та якісного аналізу підприємницького ризику.

Якісний аналіз підприємницьких ризиків. Характеристика основних зон ризику. Причини виникнення основних видів господарських ризиків.

Сутність політичних ризиків та їхній вплив на поведінку суб'єктів господарювання. Оцінювання ступеня політичного ризику за методикою Всесвітнього Банку.

Соціальні ризики як наслідок соціального напруження, їх передбачення та вплив на діяльність підприємств.

Характеристика адміністративно-законодавчих ризиків. Ризики, що

виникають у результаті невирішеності проблем щодо забезпечення прав власності, та причини їх виникнення. Сутність податкових ризиків та їх урахування в підприємницькій діяльності.

Виробничі ризики. Джерела ризиків НДДКР, безпосередньо виробничих і постачальницьких ризиків. Причини та різновиди транспортних ризиків.

Комерційні ризики. Джерела виникнення безпосередньо реалізаційних ризиків; ризиків взаємодії з контрагентами та партнерами в процесі організації продажу продукції (послуг); ризиків непередбаченої конкуренції.

Фінансові ризики. Причини виникнення ризиків, пов'язаних з укладенням капіталу (інвестиційні ризики); ризиків незабезпечення господарської діяльності необхідним фінансуванням; ризиків, пов'язаних з купівельною спроможністю грошей; ризиків непередбачення витрат і перевищення кошторису витрат на виробництво.

Кількісний аналіз підприємницьких ризиків. Імовірні втрати у процесі здійснення підприємницької діяльності. Ступінь ризику. Система показників абсолютного та відносного вимірювання ризику. Крива ризику та процес її побудови.

Методи кількісного оцінювання ризиків. Переваги й недоліки основних методів кількісного оцінювання підприємницьких ризиків. Методи оцінювання ризикованості інвестиційних проектів. Переваги й недоліки методів кількісного оцінювання ризику інвестиційних проектів. Аналіз варіабельності прибутку.

Література [1 – 7; 8-10; 12-16; 20-25]

Тема 8. Основи ризик-менеджменту

Необхідність управління ризиками господарської діяльності. Сутність ризик-менеджменту. Структурна схема ризик-менеджменту. Функції керованої та керуючої підсистем управління ризиками. Відділ з управління підприємницькими ризиками. Процес управління ризиками господарської

діяльності на підприємстві та характеристика його етапів.

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. Модуль «імовірність виникнення втрат/рівень збитків» для пошуку рішення щодо оптимізації ступеня ризику.

Література [1 – 7; 8-12; 14-16; 19-27]

ВКАЗІВКИ ДО ВИКОНАННЯ КОНТРОЛЬНОЇ РОБОТИ

Згідно з навчальним планом кожен студент заочної форми навчання повинен виконати контрольну роботу. Варіант контрольної роботи, яку потрібно виконати, визначається таким чином: обирається номер варіанта завдання відповідно до порядкового номеру букви алфавіту, з якої починається прізвище. Загальний обсяг контрольної роботи (реферату) – не менше 20 сторінок комп'ютерного набору. Рекомендований шрифт – Times New Roman, розмір шрифту – 14, інтервал між рядками – 1,5.

Контрольна робота (реферат) є формою самостійного опанування студентами заочного чи стаціонарного відділень окремих розділів курсу «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків».

Робота повинна бути відповідним чином оформлена:

1. Обов'язкове правильне оформлення титульної сторінки: у правій верхній частині – індекс навчальної групи та номер залікової книжки, повне прізвище, ім'я та по батькові студента; повна домашня адреса; назва організації, в якій працює студент, її адреса та займана посада. В середній частині титульної сторінки подається інформація про форму роботи (реферат), після цього наводиться назва дисципліни і назва самої роботи. Крім цього, вказуються прізвище та ініціали викладача (наукового керівника).

2. Для виконання контрольної роботи (реферату) необхідно розробити її

план. У загальному вигляді його можна подати так:

- 1) вступ. У ньому зазначається актуальність і викладаються основні положення теми, ступінь її розробки, цілі та завдання;
- 2) інформація про виникнення проблеми (поняття), терміну; визначення проблеми (поняття) об'єкта та предмета вивчення;
- 3) обґрунтування місця та ролі аналізованої проблеми, її теоретична та практична значущість;
- 4) зв'язок першого розділу курсу з іншими розділами;
- 5) характеристика сучасного стану проблеми (тут подається основний текст роботи). Цей розділ можна поділити на кілька підрозділів;
- б) висновки та пропозиції щодо усунення виявлених недоліків у процесі вивчення та аналізу матеріалу останнього розділу;
- 7) перелік використаних джерел.

Під час написання роботи бажано вирішити два завдання:

- а) показати вміння самостійно і творчо працювати з літературою;
- б) довести, що Ви можете аналізувати ключові глобальні проблеми економічного розвитку за допомогою цивілізаційного виміру глобальних економічних процесів.

Значущість плану контрольної роботи (реферату) можна оцінити виходячи з відомого ствердження, за яким чітко розроблений та написаний план – це вже половина виконаної роботи.

3. При розробці теми слід здійснити:

- а) пошук необхідної інформації (теоретичних матеріалів, фактів, статистичних даних);
- б) аналіз наявних матеріалів, пов'язаних з темою роботи.

4. Робота значно виграє, якщо її проілюструвати таблицями, діаграмами, графіками тощо.

5. Мова роботи має носити науковий характер, але водночас бути доступною. У роботі бажано подати бачення проблеми, викласти свої думки

та особисте ставлення до аналізованих явищ, внести пропозиції та аргументувати їх.

6. Правильно посилатися на науковий, інформаційний або статистичний матеріал.

Джерела можна розміщувати у списку різними способами: у порядку посилань у тексті (найзручніший для користування), в алфавітному порядку за прізвищами перших авторів або заголовками, у хронологічному порядку.

Зокрема, посилюючись на книгу, у списку літератури (переліку використаних джерел) необхідно зазначити прізвище та ініціали автора (авторів), назву книги, місце, назву видавництва та рік видання, загальний обсяг роботи (кількість сторінок). Якщо йдеться про окрему статтю з журналу, то необхідно навести прізвище та ініціали автора (авторів), назву статті та журналу, рік видання та його номер, вказати номери сторінок, на яких знаходиться стаття. Так само оформляються статті, опубліковані у щотижневиках і газетах. Виходячи з цього у тексті можна послатися на певне джерело таким чином: у квадратних дужках зазначається номер джерела за вашим списком літератури та номер сторінки, на яку ви посилаєтесь. Наприклад: [4, с.48].

7. У роботі повинні бути пронумеровані всі сторінки. Першою сторінкою вважається титульна. На правій якщо ви пишете на одній сторінці) чи лівій (якщо ви пишете на зворотній сторінці) стороні необхідно залишити поле розміром не менше 2 см.

Якщо робота виконана без дотримання зазначених рекомендацій, то викладач може повернути її на доробку без перевірки.

Практика перевірки робіт свідчить, що окремі студенти не дотримуються викладених рекомендацій і допускають низку грубих порушень. Серед них зазначимо такі порушення, як списування у своїх колег, а також безпосереднє переписування певного параграфу з книги або окремої статті з журналу, копіювання чужої роботи. У результаті студенти

отримують за свої роботи незадовільні оцінки або ж їхні роботи взагалі не зараховуються. У такому разі студентам доведеться виконати контрольну роботу за новою темою.

Після завершення студент здає роботу до деканату факультету за місяць до екзаменаційної сесії. Деканат передає роботу викладачеві для її перевірки та оцінювання.

Контрольна робота (реферат) – це форма зворотного зв'язку студента з викладачем. Такий зв'язок дає змогу викладачеві перевірити хід виконання навчальної програми, якість вивчення навчально-методичної та наукової літератури і рівень набутих знань. Контрольна робота (реферат) свідчить про ступінь засвоєння отриманих знань за курсом певної дисципліни, про грамотність, загальну культуру і ерудованість студента.

Остаточню оцінку викладач оцінює роботу під час індивідуальної співбесіди зі студентом. Позитивна оцінка рецензованої роботи – одна з важливих умов заліку чи екзамену з дисципліни «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків».

ТЕМИ КОНТРОЛЬНИХ РОБІТ

1. Способи формалізації та реалізації господарських рішень. Визначення оптимальних форм представлення та реалізації господарських рішень.
2. Види ефективності господарських рішень.
3. Принципи оцінки ефективності господарських рішень.
4. Стили прийняття рішень.
5. Класична, поведінкова та ірраціональна моделі прийняття рішень.
6. Закони та закономірності, що впливають на прийняття рішень.
7. Методи розробки господарських рішень.
8. Експертні методи та умови їх застосування.
9. Ділові та організаційно-діяльнісні ігри.
10. Сутність та види методу «дерево цілей».
11. Прогнозування та аналіз господарських рішень.

12. Основні завдання та ключові принципи прогнозування господарських рішень.
13. Сутність та принципи аналізу господарських рішень.
14. Методи аналізу господарських рішень та їх інструментарій.
15. Обґрунтування господарських рішень.
16. Методичні основи обґрунтування господарських рішень.
17. Контроль за перебігом виконання господарських рішень та його види.
18. Особливості функціонування підприємств за умов невизначеності.
19. Сутність та основні причини невизначеності.
20. Урахування факторуневизначеності в управлінні підприємством і засоби її зниження.
21. Характеристика критеріїв обґрунтування господарських рішень в умовах невизначеності.
22. Обґрунтування господарських рішень в умовах ризику. Критерії прийняття господарських рішень за умов ризику. Прийняття рішень в конфліктних ситуаціях.
23. Проектний ризик та прийняття господарських рішень.
24. Критерії обґрунтування рішень у процесі прийняття (вибору) інвестиційного проекту.
25. Систематичний ризик та сподівана дохідність компанії.
26. Формування оптимального портфеля з обмеженої кількості цінних паперів.
27. Межі застосування кількісних та якісних методів аналізу певного підприємницького ризику.
28. Сутність системних та несистемних (унікальних) ризиків та можливості зведення їх до мінімуму.
29. Сутність політичних ризиків та їх вплив на поведінку суб'єктів господарювання.

30. Походження соціальних ризиків та їх співвідношення із соціальним становищем.

31. Методи зниження ступеня ризику.

32. Сутність системи страхування підприємницьких ризиків.

ПИТАННЯ ДЛЯ САМОКОНТРОЛЮ

1. Поняття господарських рішень та їх ознаки.
2. Господарські рішення та їх види.
3. Вимоги до господарських рішень та умови їх досягнення.
4. Способи формалізації та реалізації господарських рішень. Визначення оптимальних форм представлення та реалізації господарських рішень.
5. Основні параметри якісного рішення.
6. Основні умови забезпечення якості господарського рішення.
7. Види ефективності господарських рішень. Умови та перешкоди прийняття ефективного рішення.
8. Елементи процесу прийняття рішень.
9. Етапи та процедури процесу прийняття рішень.
10. Стили прийняття рішень.
11. Основні моделі та засоби прийняття рішень.
12. Методи аналізу господарських рішень.
13. Логістичні підходи до прийняття рішень.
14. Розрахунково-аналітичні методи.
15. Експертні методи та межі їх застосування.
16. Класична, поведінкова та ірраціональна моделі прийняття рішень.
17. Умови прийняття господарських рішень, залежно від ступеню визначеності інформації.
18. Контроль за ходом виконання господарських рішень.
19. Закони та закономірності, що впливають на прийняття рішень.

20. Загальні закони управління людиною. Закон інерційності людських систем.

21. Закони зв'язку з зовнішнім середовищем. Соціально-психологічні і біопсихічні закони.

22. Сутнісно-змістовна характеристика та класифікація системи показників економічного обґрунтування господарських рішень.

23. Критерії економічної ефективності господарських рішень.

24. Існуючі підходи до вибору системи показників економічної ефективності.

25. Прогнозування та аналіз господарських рішень.

26. Основні задачі та ключові принципи прогнозування господарських рішень.

27. Сутність та принципи аналізу господарських рішень.

28. Сутнісна характеристика процесу реалізації господарських рішень.

29. Система забезпечення реалізації рішень.

30. Сутність та види невизначеності.

31. Особливості функціонування підприємств за умов невизначеності. Необхідність та доцільність урахування підприємствами фактору невизначеності. Основні причини невизначеності. Видова класифікація невизначеності.

32. Характеристика критеріїв обґрунтування господарських рішень в умовах невизначеності.

33. Теорія корисності в системі процесів прийняття рішень.

34. Детермінований еквівалент лотереї, премія за ризик, страхова сума.

35. Умови схильності, несхильності, байдужості до ризику.

36. Методика побудови функції корисності.

37. Характеристика ризику як економічної категорії.

38. Сутнісно-змістовна характеристика ризику.

39. Класифікація підприємницьких ризиків.

40. Характеристика підприємницьких ризиків за місцем їх походження та ступенем впливу на результати діяльності підприємств.

41. Обґрунтування господарських рішень в умовах ризику. Критерії прийняття господарських рішень за умов ризику. Прийняття рішень в конфліктних ситуаціях

42. Проектний ризик та прийняття господарських рішень.

43. Критерії обґрунтування рішень при прийнятті (вборі) інвестиційного проекту.

44. Коефіцієнт систематичного ризику.

45. Систематичний ризик та сподівана дохідність компанії

46. Сутність фінансових рішень та їх класифікація.

47. Теорія оптимального портфелю.

48. Формування оптимального портфеля з обмеженої кількості цінних паперів.

49. Межі застосування кількісних та якісних методів аналізу певного підприємницького ризику.

50. Якісний аналіз підприємницьких ризиків.

51. Сутність системних та несистемних /унікальних/ ризиків та можливості зведення їх до мінімуму

52. Сутність політичних ризиків та їх вплив на поведінку суб'єктів господарювання.

53. Походження соціальних ризиків та їх співвідношення з соціальним становищем.

54. Характеристика адміністративно-законодавчих ризиків.

55. Сутність податкових ризиків та їх урахування в підприємницькій діяльності.

56. Сутність виробничих ризиків, їх класифікація та вплив на діяльність підприємства.

57. Сутність постачальних ризиків, їх передбачення та заходи запобігання.

58. Сутність ризиків збуту, прогнозування їх виникнення та можливі заходи запобігання. Особливості збутових ризиків у зовнішньоекономічній діяльності підприємства.

59. Безпосередньо-виробничі ризики.

60. Характеристика ризиків в комерційній діяльності підприємства.

61. Кількісний аналіз ризиків господарювання.

62. Характеристика методів кількісної оцінки ризиків.

63. Характеристика методів оцінки ризикованості інвестиційних проектів

64. Переваги та недоліки основних методів кількісної оцінки підприємницьких ризиків.

65. Переваги та недоліки основних методів кількісної оцінки ризику інвестиційних проектів.

66. Особливості управління ризиками господарської діяльності.

67. Структурна схема ризик-менеджменту.

68. Напрями та методи регулювання ступеню ризику.

69. Методи зниження ступеню ризику.

70. Характеристика процесу диверсифікації, її переваги та недоліки.

71. Сутність системи страхування підприємницьких ризиків.

72. Система функціонування моделі подвійного захисту різних видів підприємницької діяльності.

73. Організаційні фактори впливу на прийняття господарських рішень.

74. Місце економічного обґрунтування в системі підготовки і прийняття рішень.

75. Теорія корисності в системі процесів прийняття рішень.

76. Класифікація методів розробки, прийняття і реалізації рішень.

77. Математичні методи і прийоми при обґрунтуванні господарських рішень.

78. Проектний ризик та прийняття господарських рішень.
79. Характеристика ризиків у комерційній діяльності підприємства.
80. Система показників абсолютного та відносного вимірювання ризику.
81. Особливості процесу хеджування ризиків.
82. Сутність інвестиційних ризиків, їх види та причини виникнення.
83. Характеристика методів оцінювання ризикованості інвестиційних проектів.
84. Сутність системи страхування підприємницьких ризиків.
85. Ризики зовнішньоекономічної діяльності підприємства.
86. Напрями та методи регулювання ступеня ризику.
87. Види рішень залежно від характеру дій.
88. Вимоги до господарських рішень.
89. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності.
90. Ретроспективна оцінка та прогнозування.
91. Розпізнавання ситуації як етап прийняття рішень.
92. Евристичні методи розробки та прийняття управлінських рішень.
93. Переваги та недоліки основних методів кількісного оцінювання підприємницьких ризиків.
94. Оцінка ефективності варіантів рішень (альтернатив).
95. Вплив невизначеності на оцінку варіантів рішень.
96. Фінансові результати: прибуток, збиток від реалізації господарського рішення.
97. Принципи економічного обґрунтування.
98. Аналітичні методи обґрунтування.
99. Аналіз абсолютних, відновних та середніх величин.

СПИСОК ЛІТЕРАТУРИ

Основна

1. Клименко С. М., Дуброва О. С. Обґрунтування господарських рішень та оцінка ризику. — К.: КНЕУ, 2005. — 272 с.
2. Клименко С. М., Дуброва О. С. Обґрунтування господарських рішень та оцінка ризику. — навч.- метод. посібник для самост. вивч. дисц. — К.: КНЕУ, 2006. — 182с.
3. Вітлінський В. В. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком: Навч.-метод. посіб. для самост. вивч. дис. — К.: КНЕУ, 2000. — 292 с.
4. Вітлінський В. В. Ризик у менеджменті. — К.: ТОВ «Борисфен», 1996. — 326 с.
5. Смирнов Э. А. Разработка управленческих решений: Учеб. для вузов. — М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2002. — 271 с.
6. Устенко О. Л. Предпринимательские риски: основы теории, методология оценки и управление. — К.: Асеусвит, 1996. — 146 с.
7. Машина Н. І. Економічний ризик і методи його вимірювання: Навч. посіб. — К.: ЦНЛ, 2003. — 188 с.

Додаткова

8. Альгин А. П. Риск и его роль в общественной жизни. — М.: Мысль, 1989. — 192 с.
9. Андрійчук, В. Г. Менеджмент: Прийняття рішень і ризик: Навч. посіб. — К: КНЕУ, 1998. — 316 с.
10. Бачкай Т., Месена Д. и др. Хозяйственный риск и методы его измерения. — М.: Экономика, 1979. — 184 с.
11. Василенко В. А. Теорія і практика розробки управлінських рішень: Навч. посіб. — К.: ЦУЛ, 2002. — 420 с.
12. Вітлінський В. В., Великоіваненко Г. І. Ризикологія в економіці та підприємстві: Монографія. — К: КНЕУ, 2004. — 480 с.

13. Воронцовский А. В. Управление рисками: Учеб. пособие — 2-е изд., испр. и доп. — СПб.: Изд-во С.-Петербур. ун-та; ОЦЭМ, 2004. — 458 с.
14. Вяткин В. Н., Гамза В. А., Хэмптон Дж. Дж. Управление риском в рыночной экономике. — М.: Экономика, 2002. — 195 с.
15. Глущенко В. А., Глущенко И. И. Разработка управленческого решения. Прогнозирование—планирование. Теория проектирования экспериментов. — Железнодорожный: Крылья, 2000. — 400 с.
16. Гоберман В. А., Гоберман Л. А. Основы производственного менеджмента: моделирование операций и управленческих решений: Учеб. пособие. — М.: Юристъ, 2002. — 336 с.
17. Дерлоу Д. Ключові управлінські рішення: Технологія прийняття рішень: Пер з англ. — К.: Всеувито, Наук. думка, 2001. — 242 с.
18. Економічний ризик: ігрові моделі: Навч. посіб. / В. В. Вітлінський, П. І. Верченко та ін. — К.: КНЕУ, 2002. — 446 с.
19. Івченко І. Ю. Економічні ризики: Навч. посіб. — К.: ЦУЛ, 2004. — 304 с.
20. Колпаков В. М. Теория и практика принятия управленческих решений: Учеб. пособие. — К.: МАУП, 2000. — 256 с.
21. Рапопорт Б. М. Оптимизация управленческих решений. — М: ТЕИС, 2001. — 264 с.
22. Ременников В. В. Разработка управленческого решения: Учеб. пособие для вузов. — М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2000. — 144 с.
23. Риски в современном бизнесе / П. Г. Грабовый и др. — М.: Аланс, 2001. — 200 с.
24. Рогальский Ф. Б., Курилович Я. Е., Цокуренок А. А. Математические методы анализа экономических систем. Кн. 1. Теоретические основы. — К.: Наук. думка, 2001. — 230 с.
25. Станиславчик Е. Н. Риск-менеджмент на предприятии: Теория и практика. — М.: Ось-89, 2002. — 80 с.

26. Уткин Э. А. Риск-менеджмент: Учебник — М.: Тандем, 1998. — 288 с.
27. Фелькер Р. Использование теории игр в практике управления // Менеджмент и маркетинг. — 1999. — № 5.
28. Хохлов Н.В. Управление риском: Учеб. пособие для вузов. — М.: ЮНИТИ-ДАНА, 1999. — 239 с.

ЗМІСТ

Пояснювальна записка	
Тематичний план дисципліни «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків»	
Зміст дисципліни «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків»	
Вказівки до виконання контрольної роботи	
Теми контрольних робіт	
Питання для самоконтролю	
Список літератури	