

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ  
ЧОРНОМОРСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ  
ІМЕНІ ПЕТРА МОГИЛИ

СХВАЛЕНО:  
Вченою радою  
ЧНУ ім. П.Могили  
Протокол № 3  
« 09 » 11 2014р.

ЗАТВЕРДЖЕНО:  
Ректор ЧНУ ім. Петра Могили  
Л.П. Клименко  
« 09 » 11 2014р.



НАВЧАЛЬНА ПРОГРАМА

з ДИСЦИПЛІНИ

«ЛОГІСТИЧНИЙ МЕНЕДЖМЕНТ»

Статус дисципліни: вибіркова  
Галузь знань: 0306 «Менеджмент та адміністрування»  
Напрямок підготовки: 6.030601 «Менеджмент»  
Форма навчання: денна

Перший проректор

Н.М. Іщенко

В.о. декана факультету економічних наук

О.Б. Філімонова

Завідувач кафедри менеджменту

О.Ю. Стоян

Розглянуто на засіданні методичної ради факультету  
« 07 » 11 2014р.  
Протокол № 60/14

Миколаїв – 2014р.

## 1. Загальні положення

В ринкової економіки, праці провідних вчених та спеціалістів-практиків в галузі врахування чинників невизначеності та ризику при вирішенні практичних задач, діючі нормативні акти, що регламентують діяльність підприємств з різними видами організаційно-правової форми власності.

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" є базовою навчальною дисципліною та вивчається згідно з навчальним планом підготовки фахівців освітнього рівня "бакалавр" спеціальності 6.030601 «Менеджмент» всіх форм навчання.

**Мета вивчення:** формування знань і навичок стосовно обґрунтування господарських рішень з різним ступенем невизначеності та ризику.

Основними **завданнями** вивчення дисципліни «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків» є:

- 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.

### **Передумови вивчення дисципліни:**

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.

***Очікувані результати навчання:***

- демонструвати навички виявлення проблеми та обґрунтування управлінських рішень;
- виявляти навички пошуку, збирання та аналізу інформації, розрахунку показників для обґрунтування управлінських рішень;
- здатність до проведення досліджень на відповідному рівні ;
- знання та розуміння: міжнародних норм і законодавства України у сфері безпеки життєдіяльності населення, система управління охороною праці та цивільного захисту.

Згідно з вимогами освітньо-професійної програми у здобувачів вищої освіти має бути сформовані наступні елементи загальної компетентності:

- навички використання інформаційних і комунікаційних технологій;
- здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях;
- здатність до адаптації та дії в новій ситуації;
- здатність генерувати нові ідеї (креативність).

Знання, які студенти отримують при вивченні навчальної дисципліни «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків», є вибірковою для інших професійно-орієнтованих дисциплін

*В результаті вивчення дисципліни студент:*

***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;
- природу виникнення ризиків, їх різновиди, вплив на якість господарських рішень;
- методичні основи кількісного та якісного аналізу підприємницьких ризиків;
- теоретичні аспекти ризик-менеджменту та напрями регулювання підприємницьких ризиків.

### **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 підприємств.

### **Форми вивчення дисципліни:**

лекція, семінарські заняття, виконання індивідуальних завдань, самостійної роботи, контрольні заходи. Технічні засоби навчання використовуються під час усіх форм занять згідно з рекомендаціями предметно-методичної комісії.

У процесі вивчення дисципліни використовується кредитно-модульна технологія за якою студенти опановують матеріал по одному змістовному модулю.

Лекційне подання матеріалу проводиться з широким використанням проблемно-діяльнісного підходу, що сприяє глибокому засвоєнню знань і формуванню творчого професійного мислення у майбутніх фахівців.

На семінарських заняттях, які носять проблемно-пошуковий і практично-творчий характер, студенти вирішують теоретичні і практичні завдання, розвивають мислення, поглиблюють і розширюють знання, висувають і відстоюють свою точку зору, пропонують та обґрунтовують шляхи їх вирішення.

Під час виконання індивідуальних завдань студенти, за допомогою викладача, розв'язують складні проблеми і незрозумілі питання, обговорюють нові підходи практичного застосування отриманих знань у ході професійної діяльності.

Самостійна робота планується як форма організації навчального процесу, що має на меті надати допомогу у самостійному вивченні запропонованої літератури у пошуку відповідей на проблемні питання курсу, виконання практичних завдань курсу.

Форми контролю – поточний, модульний, підсумковий семестровий контроль.

Поточний контроль ґрунтується на системі оцінки успішності студентів і проводиться на семінарських заняттях: опитування і реферати, контрольні роботи, тестування.

Модульний контроль у відповідності до «Тимчасового положення про кредитно-модульну систему організації навчального процесу Чорноморського державного університету імені Петра Могили».

## 2. Опис навчальної дисципліни

Найменування показника	Характеристика дисципліни		
Найменування дисципліни	<b>«Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків»</b>		
Галузь знань	0306 «Менеджмент та адміністрування»		
Спеціальність	6.030601 «Менеджмент»		
Спеціалізація (якщо є)			
Освітня програма	Менеджмент		
Рівень вищої освіти	Бакалавр		
Статус дисципліни	Нормативна		
Курс навчання	2		
Навчальний рік	2016-2017		
Номер(и) семестрів (триместрів):	Денна форма	Заочна форма	
	5		
Загальна кількість кредитів ЄКТС/годин	4 кредита / 120 годин		
Структура курсу:	Денна форма	Заочна форма	
	– лекції	28	
	– семінарські заняття (практичні, лабораторні, півгрупові)	28	
	– годин самостійної роботи студентів	64	
Відсоток аудиторного навантаження	47%		
Мова викладання	українська		
Форма проміжного контролю (якщо є)			
Форма підсумкового контролю	іспит		

## **Змістовий модуль 1.**

### **Тема 1. Сутнісна характеристика господарських рішень**

Поняття господарських рішень та їхні ознаки. Класифікація господарських рішень. Вимоги до господарських рішень та умови їх досягнення. Якість та ефективність господарських рішень. Основні параметри та показники якісного рішення. Умови забезпечення якості господарського рішення. Види ефективності господарських рішень. Принципи оцінювання ефективності господарських рішень.

### **Тема 2. Технологія прийняття рішень господарської діяльності**

Необхідність прийняття господарських рішень. Процес прийняття рішень та його елементи. Етапи та процедури процесу прийняття рішень. Стилi прийняття рішень. Основні способи прийняття рішень. Моделі прийняття рішень. Основні чинники, що впливають на прийняття рішення. Контроль за процесом виконання господарських рішень. Характеристика видів контролю. Закони й закономірності, що впливають на прийняття рішень

### **Тема 3. Методичні основи підготовки 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.

Методи розроблення господарських рішень. Методичні основи обґрунтування господарських рішень. Підходи до обґрунтування й вибору господарських рішень. Прогнозування та аналіз господарських рішень. Сфери застосування методів та інструментів прийняття господарських рішень.

### **Тема 4. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання їх ефективності.**

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.

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.

## **Змістовий модуль 2.**

### **Тема 5. Невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності.**

Сутність невизначеності. 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.

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 6. 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. 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 7. Критерії прийняття господарських рішень за умов ризику**  
Інвестиційні рішення та критерій ефективності їх прийняття. Критерій 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.

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.

### **Тема 8. Якісне оцінювання підприємницьких ризиків.**

Сутність кількісного та якісного аналізу підприємницького ризику. Якісний аналіз підприємницьких ризиків. Характеристика основних зон ризику. Причини виникнення основних видів господарських ризиків. Види ризиків та їх класифікація. Кількісний аналіз підприємницьких ризиків. Методи кількісного оцінювання ризиків. Переваги й недоліки основних методів кількісного оцінювання підприємницьких ризиків.

### **Тема 9. Основи ризик-менеджменту**

Сутність ризик-менеджменту. Структурна схема ризик-менеджменту. Функції керованої та керуючої підсистем управління ризиками. Процес управління ризиками господарської діяльності на підприємстві та характеристика його етапів. Основні напрями й методи впливу на ступінь ризику господарювання. 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.



### 3. ЗМІСТ ДИСЦИПЛІНИ

#### 3.1. План лекцій

№	Тема заняття / план
1	<b>Тема 1. Сутнісна характеристика господарських рішень</b> <ol style="list-style-type: none"><li>1. Поняття господарських рішень та їхні ознаки.</li><li>2. Класифікація господарських рішень.</li><li>3. Вимоги до господарських рішень та умови їх досягнення.</li><li>4. Способи формалізації та реалізації господарських рішень.</li><li>5. Визначення оптимальних форм подання та реалізації господарських рішень.</li></ol>
2	<b>Тема 2. Технологія прийняття рішень господарської діяльності</b> <ol style="list-style-type: none"><li>1. Процес прийняття господарських рішень та його елементи.</li><li>2. Основні моделі прийняття рішень.</li><li>3. Характер, середовище та умови прийняття господарських рішень.</li><li>4. Закони та закономірності, що впливають на прийняття рішень</li></ol>
3	<b>Тема 3. Методичні основи підготовки господарських рішень</b> <ol style="list-style-type: none"><li>1. Технологія прийняття господарських рішень.</li><li>2. Методи розробки рішень господарської діяльності.</li><li>3. Обґрунтування господарських рішень.</li><li>4. Прогнозування та аналіз господарських рішень.</li></ol>
4	<b>Тема 4. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання їх ефективності</b> <ol style="list-style-type: none"><li>1. Основні параметри та показники якісного рішення.</li><li>2. Оцінювання якості господарських рішень.</li><li>3. Види ефективності господарського рішення.</li><li>4. Умови та перешкоди прийняття ефективного рішення.</li><li>5. Принципи оцінювання ефективності господарських рішень.</li></ol>
5	<b>Тема 5. Невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності</b> <ol style="list-style-type: none"><li>1. Прийняття господарських рішень в умовах невизначеності.</li><li>2. Сутність та види невизначеності.</li><li>3. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності.</li><li>4. Теорії корисності в системі процесів прийняття рішень.</li></ol>
6	<b>Тема 6. Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття господарських рішень</b> <ol style="list-style-type: none"><li>1. Сутнісна характеристика ризику.</li><li>2. Чинники впливу на ступінь ризику.</li><li>3. Функції ризику в підприємницькій діяльності.</li><li>4. Класифікація підприємницьких ризиків.</li></ol>

7	<p><b>Тема 7. Критерії прийняття господарських рішень за умов ризику</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Критерії прийняття рішень за умов ризику.</li> <li>2. Прийняття господарських рішень у конфліктних ситуаціях.</li> <li>3. Інвестиційні рішення та критерії їх прийняття.</li> <li>4. Прийняття фінансових рішень за умов ризику.</li> </ol>
8	<p><b>Тема 8. Якісне оцінювання підприємницьких ризиків</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Сутність якісного аналізу ризиків підприємницької діяльності.</li> <li>2. Кількісний аналіз ризиків господарювання.</li> <li>3. Методи кількісного оцінювання підприємницьких ризиків.</li> <li>4. Експертні процедури й методи суб'єктивних оцінок при визначенні ризику</li> </ol>
9	<p><b>Тема 9. Основи ризик-менеджменту</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Особливості управління ризиками господарської діяльності.</li> <li>2. Напрями та методи регулювання ступеня ризику.</li> </ol>

## ЛІТЕРАТУРА

### 1. Основна

1. Клименко С. М. Обґрунтування господарських рішень та оцінка ризиків : навч. посіб. / С. М. Клименко, О. С. Дуброва. - К. : КНЕУ, 2015. - 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, 2016. - 262 с.

3. Пономаренко В. С. Прийняття управлінських рішень на підприємстві: процесний підхід : наукове видання / В. С. Пономаренко. - Х. : Вид. ХНЕУ, 2015. - 238 с.

### 2. Додаткова

4. Анісімова О. Неefективні управлінські рішення /О. Анісімова // Фінансовий контроль. - 2011. - № 10. - С. 34-35.

5. Буянов В. Анализ рисков в деятельности предприятия / В. Буянов // Вопросы экономики. - 2014. - № 8. - С. 128-134.

6. Буянов В. П. Рискология : управление рисками : учеб. пособ. / В. П. Буянов. - 2-е изд., испр. и доп. - М. : Экзамен, 2013. - 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 "ИНЖЕК", 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 : уч. пос. 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. Крекотун С. А. Обґрунтування господарських рішень у малому бізнесі / С. А. Крекотун // 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-е вид., випр. - Х. : ВД "ИНЖЕК", 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°, 1999. - 291 с.

### **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](http://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.nauka.com.ua/index.php?operation=1 &i id=623](http://www.economy.nauka.com.ua/index.php?operation=1&i id=623).

32. Статистика України : науковий журнал [Електронний ресурс]. - Режим доступу : [www.ukrstat.gov.ua](http://www.ukrstat.gov.ua).

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

Экономика и управление на предприятиях : научнообразовательный портал. - Режим доступа : [www.eur.ru](http://www.eur.ru).

