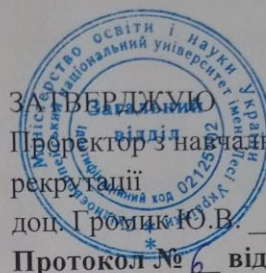


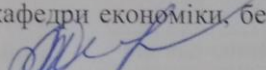
МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
Східноєвропейський національний університет імені Лесі Українки
Кафедра економіки, безпеки та інноваційної діяльності підприємства



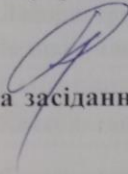
Протокол № 6 від 19.02. 2020 р.

ПРОГРАМА
нормативної навчальної дисципліни
Обґрунтування підприємницьких рішень та оцінювання ризиків
підготовки бакалавра
спеціальності 076 Підприємництво, торгівля та біржова діяльність
071 Облік і оподаткування
освітньо-професійних програм Бізнес-економіка
Облік і аудит

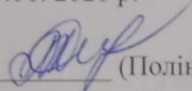
Програма навчальної дисципліни «Обґрунтування підприємницьких рішень та оцінювання ризиків» підготовки бакалавра, галузі знань 07 Управління та адміністрування, спеціальностей 076 Підприємництво, торгівля та біржова діяльність, 071 Облік і оподаткування, освітньо-професійних програм Бізнес-економіка, Облік і аудит

Розробник: Полінкевич О.М., завідувач кафедри економіки, безпеки та інноваційної діяльності підприємства, д.е.н., професор 

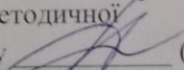
Рецензент: Ліпич Л.Г., декан факультету економіки та управління, д.е.н., професор

Програма навчальної дисципліни затверджена на засіданні кафедри економіки, безпеки та інноваційної діяльності підприємства 

протокол № 7 від 08.01. 2020 р.

Завідувач кафедри:  (Полінкевич О.М.)

Програма навчальної дисципліни схвалена науково-методичною комісією факультету економіки та управління протокол № 8 від 05.02.2020 р.

Голова науково-методичної комісії факультету  (Бегун С.І.)

Програма навчальної дисципліни схвалена науково-методичною радою Східноєвропейського національного університету імені Лесі Українки

1. ОПИС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Таблиця 1

Найменування показників	Галузь знань, спеціальність, освітньо-професійна програма, освітній рівень	Характеристика навчальної дисципліни
Денна форма навчання	07 Управління та адміністрування	Нормативна
Кількість годин/кредитів 150/5	076 Підприємництво, торгівля та біржова діяльність 051 Облік і оподаткування	Рік навчання 1
		Семестр 2-ий
ІНДЗ: €	Бізнес-економіка Облік і аудит Бакалавр	Лекції 38 год.
		Практичні (семінарські) 38 год. Лабораторні 0 год. Індивідуальні 0 год.
		Самостійна робота 62 год.
		Консультації 12 год.
		Форма контролю: екзамен

Таблиця 2

Найменування показників	Галузь знань, спеціальність, освітньо-професійна програма, освітній рівень	Характеристика навчальної дисципліни
Заочна форма навчання	07 Управління та адміністрування	Нормативна
Кількість годин/кредитів 120/4	076 Підприємництво, торгівля та біржова діяльність 051 Облік і оподаткування	Рік навчання 1
		Семестр 2-ий
ІНДЗ: €	Бізнес-економіка Облік і аудит Бакалавр	Лекції 10 год.
		Практичні (семінарські) 10 год. Лабораторні 0 год. Індивідуальні 0 год.
		Самостійна робота 98 год.
		Консультації 32 год.
		Форма контролю: екзамен

2. АНОТАЦІЯ КУРСУ:

Підвищення ефективності української економіки неможливо без серйозної перебудови принципів і механізмів управління підприємствами. Традиційний функціональний підхід до управління концентрує увагу менеджменту на окремих завданнях, персоналі, структурі, тоді як власне процеси діяльності нерідко залишаються поза увагою. Таким чином, для сучасного фахівця в галузі управління вкрай необхідно засвоїти принципи, методи й Обґрунтування підприємницьких рішень та оцінювання ризиків.

Мета навчальної дисципліни «Обґрунтування підприємницьких рішень і оцінювання ризиків» є ознайомити слухачів з технологією прийняття рішень, основами сучасної економічної ризикології та на основі набутої систематизованої інформації сформулювати комплексну систему знань і практичних навичок щодо Обґрунтування підприємницьких рішень із різним ступенем невизначеності та ризику.

Завданнями даної дисципліни є:

- усвідомити, що економічні процеси зазнають впливу некерованих чинників та відбуваються в умовах невизначеності, конфліктності, принципової неможливості здійснення точних економічних прогнозів, необхідних для прийняття економічних рішень;

- засвоїти основні принципи обґрунтування різних видів господарських рішень та оцінювання ризиків;

- набуття практичних навичок визначення ступеня і міри ризиків та інструментів впливу на їх уникнення;

формування нового економіко-математичного мислення, спрямованого на підготовку фахівців-економістів нової формації.

Об'єктом навчальної дисципліни «Обґрунтування підприємницьких рішень і оцінювання ризиків» є діяльність підприємства як система взаємопов'язаних процесів.

Предметом навчальної дисципліни «Обґрунтування підприємницьких рішень і оцінювання ризиків» є сукупність принципів, методів й інструментів обґрунтування управлінських рішень та ризиків підприємства шляхом їх моделювання, впровадження, аналізу й удосконалення.

Пререквізити: до вивчення навчальної дисципліни «Обґрунтування підприємницьких рішень і оцінювання ризиків» студент приступає, прослухавши всі загальнонаукові, гуманітарні та спеціальні навчальні дисципліни освітнього ступеня «бакалавр», зокрема такі, як економіка підприємства, маркетинг, менеджмент, планування діяльності підприємства, стратегія підприємства, макроекономіка, політична економія, вища математика, теорія статистики, теорія ймовірностей і математична статистика, математичне програмування, логіка, інформатика і комп'ютерна техніка, економетрія.

3. КОМПЕТЕНЦІЇ

Згідно з вимогами освітньо-професійної програми студенти повинні:

знати:

- основні поняття й категорії Обґрунтування підприємницьких рішень та оцінки підприємницьких ризиків;
- сучасні методи й моделі розроблення, обґрунтування та прийняття господарських рішень;
- основні принципи й підходи до Обґрунтування підприємницьких рішень в умовах невизначеності та ризику;
- 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 підприємстві.

У процесі викладання навчальної дисципліни основна увага приділяється оволодінню студентами професійною компетентністю, що наведена в табл. 4.

Таблиця 4

Професійна компетентність, яка отримується студентами після вивчення навчальної дисципліни

Назва компетентності	Складові компетентності
Здатність розуміти основні поняття теорії господарських рішень та оцінювання ризиків, впроваджувати новітні підходи до управління підприємством, створювати моделі прийняття обґрунтованих господарських рішень з	Розуміти призначення і роль господарських рішень та оцінювання ризиків
	Приймати обґрунтоване рішення щодо доцільності впровадження підходів до діяльності підприємства
	Класифікувати рішення та ризики за різними ознаками
	Будувати ланцюжок створення цінності підприємства
	Здійснювати опис стратегічних змін текстовим, табличним і графічним методами, здійснювати структурне моделювання рішень
	Обирати підхід до впровадження рішень на підприємстві,

використанням найпоширеніших стандартів моделювання, аналізувати й контролювати перебіг змін на підприємстві, а також вдосконалювати їх	впроваджувати сучасні концепції управління підприємством
	Контролювати перебіг господарських рішень на підприємстві, визначати перелік показників для виміру ефективності реалізації рішення та ризику
	Встановлювати методику вимірювання й розрахунку окремих параметрів реалізації господарських рішень та ризиків, нормативні й фактичні значення показників ефективності їхньої реалізації, визначати недоліки й резерви підвищення ефективності діяльності
	Обґрунтовувати підхід до вдосконалення кожного окремого рішення на підприємстві, створювати умови для здійснення постійного вдосконалення окремих рішень чи діяльності підприємства в цілому, реалізовувати «проривні» методики вдосконалення оцінювання підприємства

4. ІНФОРМАЦІЙНИЙ ОБСЯГ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Навчальна дисципліна може складатись з одного або кількох змістових модулів. Кількість змістових модулів визначається метою та змістом програми і не повинна перевищувати кількості кредитів, передбачених навчальним планом на вивчення дисципліни протягом семестру.

Структура навчальної дисципліни денної форми навчання представляється у вигляді таблиці 5.

Таблиця 5

Назви змістових модулів і тем	Усього	Лек.	Практ.	Сам. роб.	Конс.
Змістовий модуль 1. Обґрунтування підприємницьких рішень					
Тема 1. Сутнісна характеристика господарських рішень	14	4	4	4	2
Тема 2. Технологія прийняття рішень господарської діяльності	12	4	4	4	
Тема 3. Методичні основи підготовки господарських рішень	10	2	2	4	2
Тема 4. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання їх ефективності	12	2	2	8	
Тема 5. Прогнозування та аналіз господарських рішень	8	2	2	4	
Тема 6. Невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності	8	2	2	4	
Тема 7. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності	8	2	2	4	

Тема 8. Теорія корисності та її застосування у процесі прийняття рішень	4	2	2		2
Разом за модулем 1	78	20	20	32	6
Змістовий модуль 2. Оцінювання ризиків					
Тема 9. Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття господарських рішень	14	4	4	4	2
Тема 10. Критерії прийняття рішень за умов ризику	14	4	4	4	2
Тема 11. Прийняття рішень у конфліктних ситуаціях	10	2	2	4	2
Тема 12. Обґрунтування інвестиційних і фінансових рішень за умов ризику	10	2	2	6	
Тема 13. Якісне оцінювання підприємницьких ризиків	8	2	2	4	
Тема 14. Кількісне оцінювання підприємницьких ризиків	8	2	2	4	
Тема 15. Основи ризик-менеджменту. Напрями і методи регулювання та зниження ступеня ризику	8	2	2	4	
Разом за модулем 2	72	18	18	30	6
Всього годин:	150	38	38	62	12

Структура навчальної дисципліни заочної форми навчання представляється у вигляді таблиці 6.

Таблиця 6

Назви змістових модулів і тем	Усього	Лек.	Практ.	Сам. роб.	Конс.
Змістовий модуль 1. Обґрунтування підприємницьких рішень					
Тема 1. Сутнісна характеристика господарських рішень	8	2		4	2
Тема 2. Технологія прийняття рішень господарської діяльності	12	2		8	2
Тема 3. Методичні основи підготовки господарських рішень	12		2	8	2
Тема 4. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання їх ефективності	12		2	8	2
Тема 5. Прогнозування та аналіз господарських рішень	10			8	2

Тема 6. Невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності	10			8	2
Тема 7. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності	10			8	2
Тема 8. Теорія корисності та її застосування у процесі прийняття рішень	10			8	2
Разом за модулем 1	84	4	4	60	16
Змістовий модуль 2. Оцінювання ризиків					
Тема 9. Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття господарських рішень	14	2	2	8	2
Тема 10. Критерії прийняття рішень за умов ризику	14	2	2	8	2
Тема 11. Прийняття рішень у конфліктних ситуаціях	12		2	8	2
Тема 12. Обґрунтування інвестиційних і фінансових рішень за умов ризику	10			8	2
Тема 13. Якісне оцінювання підприємницьких ризиків	6			4	2
Тема 14. Кількісне оцінювання підприємницьких ризиків	8	2		4	2
Тема 15. Основи ризик-менеджменту. Напрями і методи регулювання та зниження ступеня ризику	8			4	4
Разом за модулем 2	66	6	6	38	16
Всього годин:	150	10	10	98	32

5. ЗАВДАННЯ ДЛЯ САМОСТІЙНОГО ОПРАЦЮВАННЯ

Самостійна робота студента (СРС) – це форма організації навчального процесу, за якої заплановані завдання виконуються студентом самостійно під методичним керівництвом викладача. Основні види самостійної роботи, які запропоновані студентам:

1. Вивчення лекційного матеріалу.
2. Робота з вивчення рекомендованої літератури.
3. Вивчення основних термінів та понять за темами дисципліни.
4. Підготовка до лабораторних занять, дискусій, роботи в малих групах, тестування.
5. Контрольна перевірка кожним студентом особистих знань за запитаннями для самоконтролю.

6. Презентація індивідуального завдання зі створення моделі існуючого бізнес-процесу підприємства та її вдосконалення з використанням нотацій IDEF0 та EPC (BPMN).

Основні види самостійної роботи, які запропоновані студентам для засвоєння теоретичних знань з навчальної дисципліни, наведені в табл. 7.

Таблиця 7

Завдання для самостійної роботи студентів та форми її контролю

Назва теми	Зміст самостійної роботи студентів	Форми контролю СРС
Тема 1. Управління промисловими ризиками	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою.	Презентація індивідуального завдання

	Виконання лабораторної роботи за темою «Побудова процесної моделі підприємства».	
Тема 2. Управління інвестиційними ризиками	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою.	Презентація індивідуального завдання
Тема 3. Управління банківськими ризиками	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою.	Презентація індивідуального завдання
Тема 4. Управління фінансовими ризиками	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою.	Презентація індивідуального завдання
Тема 5. Управління валютними ризиками	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою	Презентація індивідуального завдання
Тема 6. Управління ризиками зовнішньої діяльності	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою	Презентація індивідуального завдання
Тема 7. Управління маркетинговими ризиками	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою	Презентація індивідуального завдання
Тема 8. Управління екологічними ризиками	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою	Презентація індивідуального завдання
Тема 9. Обґрунтування прийняття господарських рішень в машинобудуванні	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою	Презентація індивідуального завдання
Тема 10. Обґрунтування прийняття господарських рішень в харчовій промисловості	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою	Презентація індивідуального завдання
Тема 11. Обґрунтування прийняття господарських рішень в легкій промисловості	Пошук, підбір та огляд літературних джерел за заданою тематикою	Презентація індивідуального завдання

Презентація здійснюється шляхом публічного виступу перед студентами. Група поділяється на підгрупи по 2–3 особи, які обирають одну із перелічених тем. Кожна група готує окремо презентацію та доповідає її. Електронний варіант презентації та доповідь групи (які не збігаються, оскільки презентація унаочнює елементи доповіді, а не дублює їх) здаються викладачу за день до визначеної дати презентації.

6. ВИДИ (ФОРМИ) ІНДИВІДУАЛЬНИХ НАУКОВО-ДОСЛІДНИХ ЗАВДАНЬ (ІНДЗ)

Передбачає виконання однієї із запропонованих тем на вибір.

1. Обґрунтування прийняття господарських рішень в металургії.

2. Обґрунтування прийняття господарських рішень в сільському господарстві.
3. Обґрунтування прийняття господарських рішень в туризмі.
4. Обґрунтування прийняття господарських рішень в страхуванні.
5. Обґрунтування прийняття господарських рішень в банківському секторі.
6. Обґрунтування прийняття господарських рішень в будівництві.
7. Обґрунтування прийняття господарських рішень в хімічній промисловості.
8. Обґрунтування прийняття господарських рішень в нафтогазовому секторі.
9. Обґрунтування прийняття господарських рішень в енергетиці.
10. Обґрунтування прийняття господарських рішень в освіті.
11. Обґрунтування прийняття господарських рішень в житлово-комунальному господарстві.

7. РОЗПОДІЛ БАЛІВ ТА КРИТЕРІЇ ОЦІНЮВАННЯ

Дисципліна складається з двох змістових модулів та її вивчення передбачає виконання ІНДЗ (табл. 8). У цьому випадку підсумкова оцінка за 100-бальною шкалою складається із сумарної кількості балів за:

1. Поточне оцінювання з відповідних тем (максимум 30 балів).
2. Виконання ІНДЗ, які зараховуються у поточний контроль (максимум 10 балів).
3. Модульні контрольні роботи (максимум 60 балів).

Таблиця 8

Денна форма навчання

Поточний контроль (мах = 40 балів)															Модульний контроль (мах = 60 балів)			Загальна кількість балів	
Модуль 1										Модуль 2		Модуль 3							
Змістовий модуль 1								Змістовий модуль 2							ІНДЗ	МКР 1	МКР 2		
T1	T2	T3	T4	T5	T6	T7	T8	T9	T10	T11	T12	T13	T14	T15		10	20	40	100
2	2	2	2	2	2	2	2	2	2	2	2	2	2	2		10	20	40	100

Таблиця 8

Заочна форма навчання

Поточний контроль (мах = 40 балів)															Модульний контроль (мах = 60 балів)			Загальна кількість балів	
Модуль 1										Модуль 2		Модуль 3							
Змістовий модуль 1								Змістовий модуль 2							ІНДЗ	МКР 1	МКР 2		
T1	T2	T3	T4	T5	T6	T7	T8	T9	T10	T11	T12	T13	T14	T15		10	20	40	100
		10	10							10						10	20	40	100

Шкала оцінювання

Таблиця 6

Оцінка в балах за всі види навчальної діяльності	Оцінка	
	для екзамену	для заліку
90 – 100	Відмінно	Зараховано
82 – 89	Дуже добре	
75 - 81	Добре	
67 -74	Задовільно	
60 - 66	Достатньо	
1 – 59	Незадовільно	Незараховано (з можливістю повторного складання)

8. РЕКОМЕНДОВАНА ЛІТЕРАТУРА

1. Вітлінський В. В. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком : [навч.-метод. посіб. для самост. вивч. дис.] / В. В. Вітлінський. – К. : КНЕУ, 2000. – 292 с.
2. Вітлінський В. В. Ризик у менеджменті / В. В. Вітлінський. – К. : ТОВ «Борисфен», 1996. – 326 с.
3. Клименко С. М. Обґрунтування підприємницьких рішень та оцінка ризику / С. М. Клименко, О. С. Дуброва. – К. : КНЕУ, 2004. – 272 с.
4. Машина Н. І. Економічний ризик і методи його вимірювання : [навч. посіб.] / Н. І. Машина. – К. : ЦНЛ, 2003. – 188 с.
5. Смирнов Э. А. Разработка управленческих решений : [учеб. для вузов] / Э. А. Смирнов. – М. : ЮНИТИ-ДАНА, 2002. – 271 с.
6. Устенко О. Л. Предпринимательские риски: основы теории, методология оценки и управление / О. Л. Устенко. – К. : Асеусвит, 1996. – 146 с.

9. ПЕРЕЛІК ПИТАНЬ ДО ЕКЗАМЕНУ

1. Поняття господарського рішення та його ознаки
2. Класифікація господарських рішень
3. Вимоги до господарських рішень та умови їх досягнення
4. Суб'єкти підготовки й ухвалення господарських рішень
5. Форми представлення (подання) і реалізації господарських рішень
6. Визначення оптимальних форм представлення (подання) та реалізації господарських рішень
7. Процес прийняття господарських рішень та його елементи
8. Стилі прийняття господарських рішень.

9. Головні методи прийняття господарських рішень
10. Типологія моделей прийняття господарських рішень
11. Чинники, що впливають на процес прийняття рішення.
12. Умови прийняття рішення залежно від ступеня визначеності інформації.
Ранжирування умов прийняття рішень.
13. Контроль за процесом виконання господарських рішень. Види контролю.
14. Методи розроблення господарських рішень. Аналітичні, статистичні та математичні методи.
15. Експертні методи та межі їх застосування. Види експертних оцінок.
16. Сутність евристичного програмування та його різновиди. Евристичні методи групової та індивідуальної роботи.
17. Ділові та організаційно-діяльнісні ігри.
18. Метод «сценаріїв» при розробці й прийнятті господарських рішень.
19. Сутність і види методу «дерево цілей» та його використання при розробці й прийнятті господарських рішень.
20. Методичні основи Обґрунтування підприємницьких рішень.
21. Підходи до обґрунтування й вибору господарських рішень. Комплексний підхід до Обґрунтування підприємницьких рішень.
22. Основні параметри та показники якісного рішення. Умови забезпечення якості господарського рішення.
23. Види ефективності господарських рішень.
24. Умови та перешкоди прийняття ефективного рішення.
25. Принципи оцінювання ефективності господарських рішень.
26. Основні завдання прогнозування.
27. Принципи прогнозування господарських рішень.
28. Сутність та принципи аналізу господарських рішень.
29. Методи аналізу господарських рішень та їх інструментарій.
30. Сфери застосування методів прийняття господарських рішень.
31. Причини та види невизначеності при прийнятті господарських рішень.
32. Сутність невизначеності, її зв'язок з ризиком. Підходи до визначення поняття «невизначеність».
33. Основні поняття теорії ігор, що застосовуються при обґрунтуванні рішень в умовах невизначеності. Матриця вигравів та матриця ризиків: сутність та порядок побудови.
34. Характеристика критеріїв прийняття рішень в умовах невизначеності. Максимінний критерій Вальда. Критерій максимакс.

35. Характеристика критеріїв прийняття рішень в умовах невизначеності. Мінімаксий критерій Севіджа. Критерій узагальненого оптимізму-песимізму Гурвіца.

36. Концепція корисності та передумови її застосування при обґрунтуванні господарських рішень. Категорії осіб, що приймають рішення, за критерієм ставлення до ризику.

37. Пріоритети та їх числове вираження при розробці й прийнятті господарського рішення. Функція корисності. Гранична корисність.

38. Корисність за Нейманом. Поняття лотереї. Порядок побудови функції корисності. Сподівана корисність.

39. Детермінований еквівалент лотереї. Страхова сума. Премія за ризик.

40. Різні ставлення до ризику та корисність. Несхильність та схильність до ризику. Нейтральність до ризику. Функція схильності-несхильності до ризику. Стратегічна еквівалентність.

41. Криві байдужості: економічний зміст та порядок побудови.

42. Функція корисності з інтервальною нейтральністю до ризику: економічний зміст, види, порядок побудови.

43. Причини виникнення ризику в діяльності підприємств. Необхідність врахування ризику при обґрунтуванні господарських рішень.

44. Сутність ризику як економічної категорії. Підходи до розуміння сутності ризику. Невизначеність як основа ризику. Основні риси ризику.

45. Сутність, види та умови виникнення ризикових ситуацій.

46. Сутність ситуацій ризику, їх відмінність від ситуацій невизначеності.

47. Чинники, що визначають рівень економічного ризику. Зовнішні чинники ризику (чинники прямого та непрямого впливу). Внутрішні чинники ризику.

48. Види ризику у діяльності підприємств.

49. Функції економічного ризику. Інноваційна функція. Регулятивна функція ризику та її форми. Захисна функція ризику та її аспекти. Аналітична функція.

50. Характеристика критеріїв Обґрунтування підприємницьких рішень в умовах ризику. Критерій математичного сподівання (критерій Байєса). Критерій стандартного відхилення.

51. Характеристика критеріїв Обґрунтування підприємницьких рішень в умовах ризику. Критерій Бернуллі. Критерій Лапласа. Критерій Гурвіца.

52. Сутність конфліктних ситуацій та передумови їх виникнення.

53. Основні поняття теорії ігор, що використовуються при розв'язанні конфліктних ситуацій.

54. Способи вибору оптимальних рішень в умовах конфлікту. Мажорювання стратегій. Вибір оптимальних рішень на основі чистих стратегій. Обґрунтування рішень на основі змішаних стратегій.

55. Сутність фінансових рішень, їх види.

56. Портфелі Г. Марковіца і Р. Тобіна. Теорія оптимального портфеля. Формування оптимального портфеля з обмеженої кількості цінних паперів.

57. Інвестиційні рішення. Критерії прийняття рішень при обґрунтуванні доцільності інвестицій.

58. Врахування ризику при обґрунтуванні ставки дисконтування.

59. Коефіцієнт систематичного ризику.

60. Опціонний критерій прийняття рішень.

61. Систематичний ризик і очікувана дохідність компанії.

62. Поняття аналізу ризику в діяльності підприємств. Види аналізу ризику: якісний аналіз та кількісний аналіз.

63. Сутність політичних ризиків. Оцінка політичного ризику за методикою Всесвітнього Банку.

64. Соціальні ризики, їх види та оцінка при обґрунтуванні ГР.

65. Характеристика адміністративно-законодавчих ризиків.

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

67. Виробничі ризики, їх класифікація та характеристика.

68. Ризик в інноваційній діяльності підприємства, його джерела та способи оцінки.

69. Постачальницькі та транспортні ризики, їх класифікація та характеристика.

70. Комерційні ризики: сутність, джерела, види, способи урахування.

71. Сутність і класифікація фінансових та інвестиційних ризиків.

72. Загальні підходи до кількісної оцінки ризику.

73. Вимірювання ризику в абсолютному виразі. Види втрат у діяльності підприємств та їх оцінка. Аналіз доцільності витрат. Економічний зміст та порядок побудови кривої ризику.

74. Вимірювання ризику в абсолютному виразі. Сутність критерію ймовірності та її використання при оцінці ризику.

75. Вимірювання ризику у відносному виразі. Коефіцієнт сподіваних збитків. Коефіцієнт ризику.

76. Вимірювання ризику у відносному виразі. Коефіцієнти варіації, семіваріації та семіквадратичного відхилення від зваженого середньгеометричного.

77. Вимірювання ризику у відносному виразі. Коефіцієнти асиметрії та варіації асиметрії. Коефіцієнт ексцесу та варіації ексцесу.

78. Використання нерівності Чебишева для оцінки ризику. Уникнення банкрутства при отриманні кредиту. Уникнення банкрутства при наданні кредиту. Визначення меж допустимого, критичного та катастрофічного ризику.

79. Методи оцінювання ризику інвестиційних проектів: аналіз чутливості, формалізований опис невизначеності, перевірка стійкості, коригування параметрів проекту, аналіз сценаріїв розвитку, експертний метод, аналіз ризику на основі побудови дерева рішень; методи імітаційного моделювання.

80. Переваги й недоліки окремих методів оцінки ризику.

81. Необхідність управління ризиками господарської діяльності підприємств.

82. Сутність ризик-менеджменту, його мета, завдання.

83. Характеристика процесу ризик-менеджменту на підприємстві.

84. Фінансування заходів з управління ризиком на підприємстві. Оцінка ефективності управління ризиком.

85. Класифікація методів зниження ризику.

86. Уникнення та компенсація ризику.

87. Збереження та передавання ризику.

88. Страхування та хеджування ризиків.

89. Диверсифікація як метод зниження ризику.

90. Резервування засобів на покриття непередбачуваних втрат. Принципи вибору.