

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
КРЕМЕНЧУЦЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ІМЕНІ МИХАЙЛА ОСТРОГРАДСЬКОГО
Кафедра економіки

“ЗАТВЕРДЖУЮ”

Проректор з науково-педагогічної
та методичної роботи



Віктор КОСТІН
_____ 2023 року

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Моделювання управлінських рішень та оцінювання ризиків

(шифр і назва навчальної дисципліни)

спеціальність 051 Економіка ОПІ Економіка

(шифр і назва спеціальності)

інститут, факультет, відділення Економіки і управління

(назва інституту, факультету, відділення)

Робоча програма «Моделювання управлінських рішень та оцінювання ризиків» підготовки магістра зі спеціальності 051 Економіка ОПІ Економіка
(нова початкової дисципліни)

„03” 04 2023 року.

Розробники: д.е.н., проф. Ольга МАСЛАК

(вказати авторів, їхні посади, наукові ступені та вчені звання)

Робоча програма затверджена на засіданні кафедри економіки

Протокол від “03” 04 2023 року № 25

Завідувач кафедри економіки

“ _____ ” _____ 2023 року
(підпис)  (Ольга МАСЛАК)
(прізвище та ініціали)

Схвалено

Науково-методичною Радою факультету економіки і управління
(шифр, назва)

Протокол від “04” 04 2023 року № 9

Голова  (Леся САКУН)
(підпис) (ініціали, прізвище)

1.Опис навчальної дисципліни

Найменування показників	Галузь знань, напрям підготовки, освітньо-кваліфікаційний рівень	Характеристика навчальної дисципліни	
		денна форма навчання	заочна форма навчання
Кількість кредитів – 5	Галузь знань 05 «Соціальні та поведінкові науки» (шифр і назва)	Обов’язкові навчальні дисципліни	
Модулів – 1	Спеціальність (професійне спрямування): 051 Економіка ОПП «Економіка»	Рік підготовки:	
Змістових модулів – 2		1-й	1-й
Загальна кількість годин – 150		Семестр	
		2-й	2-й
		Лекції	
		26 год.	10 год.
		Практичні, семінарські	
		24 год.	6 год.
		Лабораторні	
		-	-
		Самостійна робота	
		100 год.	134 год.
		Індивідуальні завдання	
		Вид контролю: Іспит	
Тижневих годин для денної форми навчання:	Освітньо-кваліфікаційний рівень: магістр		

2. Мета та завдання навчальної дисципліни

Програма вивчення навчальної дисципліни «Моделювання управлінських рішень та оцінювання ризиків» складена відповідно до освітньо-професійної програми підготовки магістрів зі спеціальності: 051 «Економіка» ОПП «Економіка».

Предмет: дослідження основ сучасного управлінського мислення, моделювання управлінських рішень та оцінювання ризиків з метою їх практичного застосування в майбутній професійній діяльності.

Програма навчальної дисципліни складається з таких змістових модулів:

змістовий модуль 1 – **Теоретико-методологічні основи розробки, прийняття та реалізації управлінських рішень.**

змістовий модуль 2 – **Оцінювання та моделювання ризиків при прийнятті та реалізації управлінських рішень.**

1. Мета та завдання навчальної дисципліни:

1.1. **Метою** освітнього компоненту «Моделювання управлінських рішень та оцінювання ризиків» є формування системи знань про прийняття ефективних управлінських рішень в підприємницькій діяльності, вивчення природи економічних ризиків, що виникають у процесі господарської діяльності, та ознайомлення із сучасними науковими підходами до моделювання управлінських рішень, а також навичок аналізу й оцінки ризиків та вибору управлінських рішень у різних умовах середовища та ризику.

1.2. **Основними завданнями** вивчення дисципліни є вивчення основ прийняття управлінських рішень, засвоєння теорії та методології проведення аналізу та оцінки економічних ризиків; набуття досвіду найбільш типових прийомів моделювання та вимірювання ризиків; вибору процедури пошуку і методів прийняття управлінських рішень.

1.3. Вивчення дисципліни дає можливість здобути **компетентності**, потрібні для подальшої професійної діяльності:

- ЗК 2 Здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу.
- ЗК 8 Здатність проводити дослідження на відповідному рівні.
- СК 1 Здатність застосовувати науковий, аналітичний, методичний інструментарій для обґрунтування стратегії розвитку економічних суб'єктів та пов'язаних з цимуправлінських рішень.
- СК 3 Здатність збирати, аналізувати та обробляти статистичні дані, науково-аналітичні матеріали, які необхідні для розв'язання комплексних економічних проблем, робити на їх основі обґрунтовані висновки.
- СК 4 Здатність використовувати сучасні інформаційні технології, методи та прийоми дослідження економічних та соціальних процесів, адекватні встановленим потребам дослідження.
- СК 6 Здатність формулювати професійні задачі в сфері економіки та розв'язувати їх, обираючи належні напрями і відповідні методи для їх розв'язання, беручи до уваги наявні ресурси.
- СК 7 Здатність обґрунтовувати управлінські рішення щодо ефективного розвитку суб'єктів господарювання.
- СК 8 Здатність оцінювати можливі ризики, соціально- економічні наслідки управлінських рішень.
- СК 9 Здатність застосовувати науковий підхід до формування та виконання ефективних проєктів у соціально-економічній сфері.
- СК 10 Здатність до розробки сценаріїв і стратегій розвитку соціально-економічних систем.
- СК 11* Здатність планувати і розробляти соціально-економічні проєкти в умовах відбудови економіки а інноваційних засадах та її інтеграції в європейський економічний простір, здійснювати їх інформаційне, методичне, матеріальне, фінансове та кадрове забезпечення і застосовувати їх для формування нових моделей економічних систем та процесів.

1.4. Засвоєння змісту навчальної дисципліни забезпечує формування таких

програмних результатів:

- ПРН 1 Формулювати, аналізувати та синтезувати рішення науково-практичних проблем.
- ПРН 2 Розробляти, обґрунтовувати і приймати ефективні рішення з питань розвитку соціально-економічних систем та управління суб'єктами економічної діяльності.
- ПРН 4 Розробляти соціально-економічні проєкти та систему комплексних дій щодо їх реалізації з урахуванням їх цілей, очікуваних соціально-економічних наслідків, ризиків, законодавчих, ресурсних та інших обмежень.
- ПРН 7 Обирати ефективні методи управління економічною діяльністю, обґрунтовувати пропоновані рішення на основі релевантних даних та

наукових і прикладних досліджень.

- ПРН 8 Збирати, обробляти та аналізувати статистичні дані, науково-аналітичні матеріали, необхідні для вирішення комплексних економічних завдань.
- ПРН 9 Приймати ефективні рішення за невизначених умов і вимог, що потребують застосування нових підходів, методів та інструментарію соціально-економічних досліджень.
- ПРН 10 Застосовувати сучасні інформаційні технології та спеціалізоване програмне забезпечення у соціально-економічних дослідженнях та в управлінні соціально- економічними системами.
- ПРН 11 Визначати та критично оцінювати стан та тенденції соціально-економічного розвитку, формувати та аналізувати моделі економічних систем та процесів.
- ПРН 12 Обґрунтовувати управлінські рішення щодо ефективного розвитку суб'єктів господарювання, враховуючи цілі, ресурси, обмеження та ризику.
- ПРН 13 Оцінювати можливі ризики, соціально-економічні наслідки управлінських рішень.
- ПРН 14 Розробляти сценарії і стратегії розвитку соціально-економічних систем.
- ПРН 15* Організувати розробку та реалізацію соціально-економічних проєктів в умовах відбудови економіки на інноваційних засадах та її інтеграції в європейський економічний простір із врахуванням інформаційного, методичного, матеріального, фінансового та кадрового забезпечення при трансформації економічних систем.

На вивчення навчальної дисципліни відводиться 150 годин (в т. ч. лекції – 26 год, практичні заняття – 24 год., самостійна робота – 100 год.), 5 кредитів ECTS.

3. Програма навчальної дисципліни

Змістовий модуль 1. Теоретико-методологічні основи розробки, прийняття та реалізації управлінських рішень.

Тема 1. Теоретичні основи прийняття управлінських рішень.

1. Поняття процесу прийняття управлінських рішень та їх класифікація
2. Етапи процесу прийняття ефективних управлінських рішень на основі релевантних даних та наукових і прикладних досліджень
3. Роль керівника в процесі прийняття рішень за невизначених умов і вимог, що потребують застосування нових підходів, методів та інструментарію соціально-економічних досліджень

Тема 2. Методи прийняття рішень у прогнозуванні діяльності бізнес-організації

1. Актуальні методології в системі розрахунків, прийняття і реалізації управлінських рішень
2. Порівняльний аналіз проектів різної тривалості. Оптимальні управлінські рішення. Ранжування альтернативних проектів
3. Прийняття ефективних управлінських рішень за детермінованих умов, умов ризику
4. Прийняття рішення та удосконалення процесів через застосування діджитал інструментів, необхідних для вирішення комплексних економічних завдань

Тема 3. Методи та моделі прийняття стратегічних управлінських рішень

1. Технології та методи Big Data для ефективних рішень з питань розвитку соціально-економічних систем та управління суб'єктами економічної діяльності
2. Ситуаційний аналіз і бізнес-планування. Застосування ситуаційного аналізу суб'єктами господарювання.
3. Моделі розв'язання проблем безбиткової діяльності за аналізом масивів інформації з використанням інформаційного програмного забезпечення
4. Аналітична робота з підготовки проектів управлінських рішень в умовах невизначеності

Тема 4. Вибір управлінських рішень у різних умовах середовища та ризику

1. Сутність і роль прогнозування діяльності підприємства. Вимоги до прогнозних рішень.
2. Особливості прийняття стратегічних рішень за допомогою імовірнісного підходу
3. Методи стратегічного аналізу середовища підприємства та прийняття управлінських рішень в умовах обмеженої інформації. Сценарний підхід.
4. Ситуаційні центри як ключовий механізм антикризового управління: досвід країн ЄС

Змістовий модуль 2. Оцінювання та моделювання ризиків при прийнятті та реалізації управлінських рішень

Тема 5. Ризик як економічна категорія. Його сутність. Система кількісних оцінок економічного ризику.

1. Сутність ризику як економічної категорії. Аналіз і прийняття управлінських рішень в умовах ризику.
2. Застосування блочної моделі підготовки й прийняття рішень в умовах ризику і невизначеності.
3. Система кількісних оцінок економічного ризику та ієрархічна взаємозалежність управлінських рішень.
4. Характеристика окремих видів програмного забезпечення, оцінка можливостей його використання для вибору альтернативної стратегії з найбільш оптимальними показниками (результатами).

Тема 6. Моделювання економічного ризику на основі концепції теорії гри

1. Теоретико-ігрова модель. Концепція теорії гри
 2. Інформаційна ситуація та її характеристика. Функція ризику
 3. Моделювання економічного ризику. Прийняття рішень в умовах ризику.
- Критерії прийняття рішень

Тема 7. Теорія портфеля та диверсифікація як спосіб зниження ризику.

1. Суть диверсифікації. Суть управління портфелем цінних паперів.
2. Ризик портфеля цінних паперів. Диверсифікація як спосіб зниження ризику
3. Кореляція цінних паперів: стратегії та сценарії її застосування

Тема 8. Запаси та резерви як способи зниження ступеня ризику.

1. Структура та види запасів, резервів на не передбачувані витрати
2. Ефективне управління запасами з урахуванням ризику.
3. Хеджування ризику. Зниження ризику шляхом збору додаткової інформації.

4. Структура навчальної дисципліни

Назви змістових модулів і тем	Кількість годин											
	денна форма						заочна форма					
	усього	у тому числі					усього	у тому числі				
		лек	п	л	інд	с.р.		л	п	лаб	інд	с.р.
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Змістовий модуль 1. Теоретико-методологічні основи розробки, прийняття та реалізації управлінських рішень												
Теоретичні основи прийняття управлінських рішень.	18	4	3			11	18	1,25	0,75			16
Методи прийняття рішень у прогнозуванні діяльності бізнес-організації	19	3	3			13	19	1,25	0,75			17
Методи та моделі прийняття стратегічних управлінських рішень	19	3	3			13	19	1,25	0,75			17
Вибір управлінських рішень у різних умовах середовища та ризику	19	3	3			13	19	1,25	0,75			17
Разом за змістовим модулем 1	75	13	12			50	75	5	3			67
Змістовий модуль 2. Оцінювання та моделювання ризиків при прийнятті та реалізації управлінських рішень												
Ризик як економічна категорія. Його сутність. Система кількісних оцінок економічного ризику	18	4	3			11	18	1,25	0,75			16
Моделювання економічного ризику на основі концепції теорії гри	19	3	3			13	19	1,25	0,75			17
Теорія портфеля та диверсифікація як спосіб зниження ризику	19	3	3			13	19	1,25	0,75			17
Запаси та резерви як способи зниження ступеня ризику	19	3	3			13	19	1,25	0,75			17
Разом за змістовим модулем 2	75	13	12			50	75	5	3			67
Семестровий контроль: екзамен												
Усього годин	150	26	24			100	150	10	6			134

5. Теми практичних занять

№ з/п	Назва теми	Кількість годин	
		Денне	Заочне
1	Теоретичні основи прийняття управлінських рішень.	3,0	0,75
2	Методи та моделі прийняття рішень у прогнозуванні діяльності бізнес-організації	3,0	0,75

3	Методи прийняття стратегічних управлінських рішень	3,0	0,75
4	Вибір управлінських рішень у різних умовах середовища та ризику	3,0	0,75
5	Ризик як економічна категорія. Його сутність. Система кількісних оцінок економічного ризику	3,0	0,75
6	Моделювання економічного ризику на основі концепції теорії гри	3,0	0,75
7	Теорія портфеля та диверсифікація як спосіб зниження ризику	3,0	0,75
8	Запаси та резерви як способи зниження ступеня ризику	3,0	0,75
	Разом	24	6

6. Самостійна робота

№ з/п	Назва теми	Кількість годин	
		Денне	Заочне
1	Теоретичні основи прийняття управлінських рішень.	11	16
2	Методи та моделі прийняття рішень у прогнозуванні діяльності бізнес-організації	13	17
3	Методи прийняття стратегічних управлінських рішень	13	17
4	Вибір управлінських рішень у різних умовах середовища та ризику	13	17
5	Ризик як економічна категорія. Його сутність. Система кількісних оцінок економічного ризику	11	16
6	Моделювання економічного ризику на основі концепції теорії гри	13	17
7	Теорія портфеля та диверсифікація як спосіб зниження ризику	13	17
8	Запаси та резерви як способи зниження ступеня ризику	13	17
	Разом	100	134

7. Індивідуальні завдання

використовуються індивідуальні завдання (в рамках самостійної роботи) та їх презентація відповідно до тематики курсу

8. Методи навчання

- інтерактивні лекції (дистанційні, мультимедійні, веборієнтовані);
- практичні заняття (навчальні дискусії, розв'язування задач, кросвордів, ситуаційна гра «Weekend in a Word»);
- інтерактивні методи (робота в групах, мікродослідження, імітаційна гра «Сорусат»);
- робота з навчально-методичною літературою (конспектування, тезування, складання реферату);
- відеометод у сполученні з новітніми інформаційними технологіями та комп'ютерними засобами навчання;

- методи формування пізнавальних інтересів (створення ситуації інтересу, навчальні дискусії; метод використання життєвого досвіду);
- дослідницько-пошуковий.

9. Форми оцінювання

- іспит;
- аналітичні звіти, реферати, есе (питання, відведені на самостійне опрацювання);
- презентації результатів виконаних завдань та досліджень (у тому числі виступи на науково-практичних заходах за тематикою дисципліни);
- виконання та захист практичних завдань;
- тести;
- виконання завдань на прикладі реальних об'єктів (ділові ігри, тренінги, вирішення ситуаційних завдань).

Оцінювання завдань, терміни їх виконання

№ з/п	Завдання	Терміни виконання	Критерії оцінювання
1	Завдання до практичних занять	Щотижня, згідно розкладу	Самостійність, творчість, точність, вчасність виконання завдань
2	Підготовка теоретичних питань (у тому числі питання, відведені на самостійне опрацювання)	Щотижня, згідно розкладу	Правильність, логічність, відповідність темі, оригінальність та комплексність звіту
3	Тестування з теми	Наприкінці теми	Правильність, вчасність виконання завдань
4	Модуль 1, модуль 2	Наприкінці модуля 1, 2	Самостійність, правильність виконання завдань

10. Розподіл балів, які отримують студенти

Вид занять	Змістовий модуль №1				Змістовий модуль № 2				Сума
	T1	T2	T3	T4	T5	T6	T7	T8	
Лекції	1,25	1,25	1,25	1,25	1,25	1,25	1,25	1,25	10
Практичні заняття	3,75	3,75	3,75	3,75	3,75	3,75	3,75	3,75	30
реферат	1,25	1,25	1,25	1,25	1,25	1,25	1,25	1,25	10
опитування	1,25	1,25	1,25	1,25	1,25	1,25	1,25	1,25	10
тести	2,5	2,5	2,5	2,5	2,5	2,5	2,5	2,5	20
Усього									80+20=100

T1, T2 ... T8 – теми змістових модулів.

Шкала оцінювання: національна та ECTS

Шкала оцінок				
Оцінка за національною шкалою		Проміжок за накопичувальною бальною шкалою	Оцінка ECTS	
Іспит, диф.залик, курсовий проект (робота)	залик			
Відмінно	зараховано	90 – 100	A	Відмінно

Добре		82 – 89	В	Дуже добре
		74– 81	С	Добре
64 – 73		Д	Задовільно	
60 – 63		Е	Достатньо	
Задовільно	не зараховано	35 – 59	FX	Незадовільно (дозволяється перескладання)
		1 – 34	F	Неприйнятно (повторне вивчення дисципліни)
Незадовільно				

11. Рекомендована література

Основна

1. Гаркуша Н.М. Моделі та методи прийняття рішень при аналізі та аудиті: навч. посіб. Київ, Знання, 2018. 591 с.
2. Економіка і бізнес: підручник / за ред. д.е.н., проф. Л. Г. Мельника, д.е.н., проф. О. І. Карінцевої. Суми: Університетська книга, 2021. 316 с.
3. Загірняк М.В., Перерва П.Г., Маслак О.І., Бала В.В., Коноваленко О.Д., Маслак В.І. Економіка підприємства: магістерський курс: Підручник. Частина I, частина II / За ред. професорів М.В. Загірняка, П.Г. Перерви, О.І. Маслак. Кременчук: ТОВ «Кременчуцька міська друкарня», 2015. 736 с.
4. Козирєва О. В., Світлична К.С., Шуть О.Ю., Коляда Т.А.. Основи прийняття управлінських рішень : навч. посіб. / О.В. Козирєва, Харків: Видавництво Іванченка І.С., 2021. 186 с.
5. Мулик Т.О., Материнська О.А., Пльонсак О.Л. Аналіз господарської діяльності: навчальний посібник. Київ: «Центр учбової літератури», 2017. 288 с.
6. Негрей М.В., Тужик К.Л. Теорія прийняття рішень. Навчальний посібник. Київ: Центр учбової літератури, 2018. 272 с.
7. Негрей М.В., Тужик К.Л. Теорія прийняття рішень: навч. посіб. 2018. 272 с.
8. Полінкевич О. М., Волинець І. Г. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання ризиків: навч. посіб. Луцьк : Вежа-Друк, 2018. 336 с. URL: <http://evnuir.vnu.edu.ua/handle/123456789/15846>
9. Полінкевич О. М., Волинець І. Г. Управління стратегічними змінами та інноваціями на підприємстві: навч. посібник. Луцьк : Вежа-Друк, 2018. 295с. URL: http://www.esnuir.eenu.edu.ua/bitstream/123456789/15845/1/Polinkevych_USZIP_red.pdf
10. Посилкіна О. В., Деренська Я. М. Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків : навч. посібник. Харків : НФаУ, 2018. 197 с.
11. Приймак В. М. Управління проектами. Навчальний посібник. К.: Київський національний університет імені Тараса Шевченка, 2017.– 464 с.

Допоміжна

1. Білик М.Ю., Яковенко Я.Ю., Олійник Є.В. Управління процесами цифровізації бізнес структур України в умовах пандемії.

Коллективна монографія «Вплив COVID-19 на національну безпеку, соціально-економічне середовище країни та здоров'я населення» за ред. Височиної А.В., Летуновської Н.Є., СумДУ, 2022. – с. 253-264.

2. Глазунова О.О., Таловер В.А., Марченко Є.Г., Чеголя К.Ю. (2023) Особливості бізнес-зв'язків та соціальна відповідальність партнерів при формуванні логістичної системи України. Наукові інновації та передові технології. Серія «Управління та адміністрування». № 5(19). С.30-40.

3. Маслак О.І., Гришко Н.Є., Яковенко Я.Ю., Пирогов А.Д., Дубовик О.І. (2022) Циркулярна економіка в Україні: екологічне, соціальне та корпоративне управління (ESG) як інструмент стійкості соціально-відповідального бізнесу в умовах подолання пандемії COVID-19. Вісник Національного технічного університету «ХПІ». Економічні науки. Харків. № 3, 2022. С. 3-8.

4. Маслак О.І., Перерва, П., Кобелева Т., Кучинський В., Ілляшенко С. (2021) Ефективність інформаційних технологій в управлінні інтелектуальною власністю промислового підприємства. Вісник Національного технічного університету "Харківський політехнічний інститут" (економічні науки), (1), 53–58.

5. Яковенко Я.Ю. (2019). Концепція управління стійким розвитком підприємств. Вісник ХДУ. Серія Економічні науки. 2019. № 36. С. 75-81.

6. Maslak O., Grishko N.Ye., Sokurenko P., Buriak Ie, Maslak M. (2020) Anti-crisis approach in the industrial enterprise management: methodological tools of preventive regulation (Антикризовий підхід в управлінні промисловим підприємством: методологічний інструментарій превентивного регулювання). SHS Web of Conferences. Innovative Economic Symposium 2019 Milestones and Trends of World Economy (IES2019). 73, 01018 (2020) - <https://doi.org/10.1051/shsconf/20207301018/> https://www.shs-conferences.org/articles/shsconf/pdf/2020/01/shsconf_ies_2019_01018.pdf (Web of Science)

7. Маслак О.І., Гришко Н.Є., Пирогов Д.Л., Маслак М.В. (2020) Information analytical provision in formation of innovational projects portfolio of enterprises in the context of safety-oriented management (Інформаційно-аналітичне забезпечення формування портфеля інноваційних проєктів підприємств у контексті безпекоорієнтованого управління.). Фінансово-кредитна діяльність: проблеми теорії та практики. 2020. №2 (33). URL: <http://fkd.org.ua/author/submission/140398> (Web of Science)

Інформаційні ресурси

1. Законодавство України URL: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/main/index>

2. Державна служба статистики України. URL: <http://www.ukrstat.gov.ua/>

3. Наукова та інноваційна діяльність в Україні. Статистичний збірник.

URL: http://www.ukrstat.gov.ua/druk/publicat/kat_u/publnauka_u.htm.