


МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ  
ПОЛТАВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ ТЕХНІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ  
ІМЕНІ ЮРІЯ КОНДРАТЮКА

ПОГОДЖЕНО

Директор Навчально-наукового  
інституту фінансів, економіки  
та менеджменту, д.е.н., професор

  
\_\_\_\_\_ В.В. Гришко  
« 05 » 07 \_\_\_\_\_ 2019 р.

ЗАТВЕРДЖЕНО

Проректор з наукової та міжнародної  
роботи, к.е.н., доцент

  
\_\_\_\_\_ С.П. Сівіцька  
« \_\_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 2019 р.  


**ПРОГРАМА  
ВСТУПНОГО ІСПИТУ ДО АСПРАНТУРИ**

**Галузь знань:**

**05 СОЦІАЛЬНІ ТА ПОВЕДІНКОВІ НАУКИ**

**Спеціальність: 051 – ЕКОНОМІКА**

**Рівень вищої освіти**

**ТРЕТІЙ (ОСВІТНЬО-НАУКОВИЙ)**

Програма ухвалена на засіданні вченої ради  
ННІФЕМ (протокол № 14 від « 05 » 07 2019 р.)

Полтава – 2019

## 1. ЗАГАЛЬНІ ПОЛОЖЕННЯ

Прийом до аспірантури Полтавського національного технічного університету імені Юрія Кондратюка для підготовки докторів філософії здійснюється відповідно до Закону України «Про вищу освіту», Постанови Кабінету Міністрів України від 23 березня 2016 р. № 261 «Про затвердження Порядку підготовки здобувачів вищої освіти ступеня доктора філософії та доктора наук у вищих навчальних закладах (наукових установах)», Правил прийому на навчання до Полтавського національного технічного університету імені Юрія Кондратюка у 2018 році.

Майбутній здобувач ступеня доктора філософії зі спеціальності 051 – Економіка має продемонструвати ступінь своєї компетентності з обраної спеціальності, рівень загальної, наукової і професійної ерудиції, творчий пошук нових напрямів у науковому та практичному підходах до розв'язання поставлених завдань.

Метою проведення вступного випробування для участі в конкурсі щодо зарахування на навчання за ступенем вищої освіти «доктор філософії» за спеціальністю 051 – Економіка є визначення у здобувача ступеня доктора філософії компетентностей:

- до опанування глибоких знань щодо сучасного стану, засад та принципів функціонування економічних систем, в основі яких лежать економічні закони; розуміння економічних процесів і явищ, котрі відбуваються в економічних системах різних рівнів;

- до ефективного застосування сучасних наукових методів та прийомів дослідження соціально-економічних явищ і процесів;

- до визначення об'єкта та предмета досліджень з використанням гносеологічних підходів до розв'язання проблем у галузі економіки;

- до критичного аналізу й оцінювання сучасних наукових досліджень, генерування нових ідей під час розв'язання конкретних дослідницьких і практичних завдань;

- до створення власної мережі наукових контактів із зарубіжними вченими з метою участі у міжнародних грантових проектах, проходження стажування у зарубіжних науково-дослідницьких центрах, публікації результатів наукових досліджень у престижних виданнях, які входять до міжнародних наукометричних баз даних, зокрема Scopus або Web of Science Core Collection, рекомендованих Міністерством освіти і науки України;

- до ініціювання інноваційних комплексних соціально-економічних проектів, лідерства та повної автономії під час їх реалізації, до соціальної відповідальності за результати прийняття стратегічних рішень, пов'язаних з економічним розвитком;

- до самовдосконалення у професійній сфері протягом життя, відповідальності за результати навчання інших осіб при здійсненні науково-педагогічної діяльності та наукових досліджень в економічній галузі;

- до застосування сучасних інноваційних методів і прийомів для розв'язання наукових завдань при проведенні дисертаційних досліджень у галузі економіки;

– до логічної побудови наукового дослідження відповідно до мети дослідження, наукового обґрунтування та структурування отриманих наукових положень і висвітлення результатів наукових досліджень у фахових публікаціях у вітчизняних та закордонних спеціалізованих виданнях.

Вступне випробування базується на вимогах до знань і вмінь випускника ступеня вищої освіти «магістр» і включає зміст навчальних дисциплін:

- «Глобальна економіка»;
- «Прикладна економетрика»;
- «Соціальна відповідальність»;
- «Актуарні розрахунки»;
- «Моделювання економічних ризиків»;
- «Математичні методи і моделі ринкової економіки».

Організація вступного випробування здійснюється відповідно до Положення про приймальну комісію Полтавського національного технічного університету імені Юрія Кондратюка.

## **2. ЗМІСТ ПРОГРАМИ**

### **Глобальна економіка**

Глобалізація та її суть. Глобалістика як наука, етапи її розвитку. Глобальні процеси у сучасній економіці. Характерні прояви економічної глобалізації. Збільшення відкритості національних економік. Інформатизація та транснаціоналізація світової економіки. Формування єдиної глобальної економіки.

Картографія світу у новітньому геоелектронному просторі. Геоелектронний атлас та карти, що його складають. Закономірності функціонування глобальної економіки. Економічні параметри прогностичних сценаріїв глобального розвитку. Цивілізаційний аспект глобального економічного розвитку.

Трансформація регулюючої ролі держави в економіці в умовах глобалізації. Вплив мета корпорацій на розвиток сучасної світової економіки. Міжнародні організації в системі регулювання глобальної економіки.

Основні школи сучасної глобалістики: еколого-економічна, глобальної екології, економічної соціології тощо. Еволюція створення теоретичної бази глобалістики. Дихотомічна типологія соціальної організації як основа всіх теорій глобалізації. Дискурс глобалізації, представлений теоріями Л. Склера, Р. Робертсона, У. Бека тощо.

Розвиток національних економік, посилення їх відкритості. Активізація зовнішньоекономічних зв'язків різних країн. Формування глобальних ринків. Характеристика механізмів їх функціонування.

Виникнення та розвиток транснаціональних корпорацій. ТНК як характерний суб'єкт глобальної економіки. Роль транснаціональних корпорацій у розвитку міжнародного бізнесу. Інновації як основа конкурентоспроможності ТНК.

Принципи співвідношення процесів глобалізації та регіоналізації у сучасній економіці. Формування окремих регіонів світової економіки та їх характеристика. Особливості функціонування регіональних економік, їх роль у розвитку глобальної економіки.

### **Прикладна економетрика**

Означення економетричної моделі. Види економетричних моделей. Рівняння регресії та коефіцієнт кореляції. Етапи розроблення економетричних моделей Рівняння парної лінійної регресії. Рівняння парної нелінійної регресії.

Рівняння множинної лінійної регресії. Множинна колінеарність факторів. Визначення коефіцієнтів рівняння. Перевірка адекватності моделі. Прогнозування за допомогою множинної лінійної регресії.

Означення гетероскедастичності. Критерії для визначення наявності гетероскедастичності. Визначення параметрів рівняння лінійної регресії методом Ейткена за наявності гетероскедастичності.

Означення автокореляції. Критерії для визначення наявності автокореляції. Визначення параметрів рівняння лінійної регресії методом Ейткена за наявності автокореляції.

Система незалежних регресій. Рекурсивна модель. Ідентифікація систем одночасних рівнянь. Оцінювання моделі. Непрямий метод найменших квадратів (НМНК) оцінювання параметрів системи двох регресій.

Двокроковий метод найменших квадратів. Двокроковий метод найменших квадратів для загальної економетричної моделі. Алгоритм двокрокового методу найменших квадратів.

Поняття про лагові змінні. Дистрибутивно-лагові моделі. Оцінювання параметрів вихідної форми моделі. Моделі тобіт. Моделі пробіт. Моделі логіт.

Означення панельних даних. Переваги панельних даних. Модель із фіксованими ефектами. Модель із випадковими ефектами.

Часові ряди. Адитивна та мультиплікативна моделі часових рядів. Функція автокореляції. Функція правдоподібності.

Поняття стаціонарного ряду. Поняття ARMA-моделей. Прогнозування на основі ARMA-моделей. Нестаціонарні часові ряди. ARIMA-моделі. Використання ARIMA-моделей для прогнозування економічних показників.

### **Соціальна відповідальність**

Суть та значення соціальної відповідальності бізнесу. Внутрішнє і зовнішнє середовище корпоративної відповідальності. Переваги соціальної відповідальності бізнесу. Моделі корпоративної соціальної відповідальності. Корпоративна соціальна відповідальність як складова стратегії управління та чинник підвищення конкурентоспроможності організації.

Стандарти Міжнародної організації праці та принципи Глобального договору у сфері праці. Стратегія соціально відповідальної поведінки в ринковому середовищі. Формування складової корпоративної соціальної відповідальності у відносинах зі споживачами. Міжнародні ініціативи та законодавство України у сфері захисту прав споживачів.

Соціально відповідальні відносини бізнесу і територіальними громадами

Історичні аспекти залучення і розвитку громад: від патронату до соціальних інвестицій. Вплив громади на роботу компаній та відповідальність компаній перед населенням.

Розвиток партнерств із місцевою владою й громадою. Участь компаній у життєдіяльності громад. Співпраця бізнес-структур з неурядовими організаціями. Особливості забезпечення корпоративної соціальної відповідальності у малому та середньому бізнесі.

Екологічні аспекти корпоративної соціальної відповідальності. Суть і значення відповідального ставлення організацій до довкілля. Законодавство України про охорону навколишнього середовища. Міжнародний та український досвід упровадження принципів екологічної відповідальності організацій.

Корпоративні соціальні звіти: сутність, завдання і структура. Соціальна відповідальність держави й сталий розвиток. Міжнародний досвід державного регулювання корпоративної соціальної відповідальності.

Відповідальне споживання. Культура споживання та його вплив на розвиток соціальної відповідальності бізнесу. Соціальна відповідальність ЗМІ: вплив на поведінкові моделі в суспільстві. Соціальна відповідальність освіти й науки.

Модель «Лондонської групи порівняльного аналізу» та особливості її використання. Соціальний аудит. Збалансована система показників. Концепція потрійного результату. Методи оцінювання ділової репутації соціально відповідальної компанії. Моніторинг ефективності діяльності організації у сфері соціальної відповідальності.

### **Актуарні розрахунки**

Оцінювання вартості грошей у часі. Складний і простий відсоток. Теперішня і майбутня вартість. Майбутня вартість грошових засобів за простим відсотком. Майбутня вартість грошових засобів за складним відсотком. Детерміновані ренти. Види рент. Розрахунок вартості детермінованих рент. Розрахунок теперішньої вартості грошових засобів (дисконтування). Визначення ефективної середньорічної відсоткової ставки. Обчислення теперішньої вартості анuitетів.

Математичні основи обчислення тарифних ставок. Основні статистичні характеристики. Обчислення статистичних характеристик портфеля страховика.

Моделі визначення тарифів загального страхування. Моделі загального страхування. Індивідуальна і колективна моделі для розрахунку страхових тарифів. Застосування принципу еквівалентності фінансових зобов'язань.

Моделі визначення тарифів страхування життя. Моделі короткотермінового страхування життя. Короткострокове страхування життя. Класифікація договорів. Розрахунок страхових тарифів.

Моделі довгострокового страхування життя. Довгострокове страхування життя. Класифікація договорів. Розрахунок страхових тарифів. Визначення актуарної сучасної вартості зобов'язань страховика з виплати страхового відшкодування.

Визначення страхового тарифу за класичною моделлю. Розрахунок тарифів перестраховування. Обчислення ймовірності настання страхового випадку з точки зору перестраховальної компанії. Обчислення періодичних премій. Визначення актуарної сучасної вартості ренти.

### **Моделювання економічних ризиків**

Поняття та природа економічного ризику. Класифікація ризиків. Причини виникнення економічного ризику. Особливості прояву ризиків у ринкових умовах господарювання.

Підприємницький ризик. Сутність підприємницького ризику. Причини виникнення підприємницького ризику. Функції підприємницького ризику. Класифікація підприємницького ризику.

Ризики у виробничому підприємстві. Ризики відсутності попиту на вироблену продукцію. Ризики невиконання господарських договорів (контрактів). Ризики підсилення конкуренції. Ризики виникнення непередбачених витрат та зниження доходів.

Фінансовий ризик. Ризики у фінансовому менеджменті. Трансляційний валютний ризик. Роль форвардних операцій в управлінні валютними ризиками. Роль валютних ф'ючерсів в управлінні валютними ризиками.

Інвестиційні ризики. Основні принципи розроблення інвестиційної стратегії з урахуванням ризику. Методи оцінювання інвестиційних проектів з урахуванням ризику. Ризик щодо прийняття інвестиційних рішень. Вплив інвестиційних проектів на ризик фірми.

Кількісний аналіз ризику. Методи кількісного аналізу ризику. Аналіз чутливості. Визначення ризику збитків. Наслідки кількісного аналізу ризику.

Система оцінювання ризиків. Загальні підходи до кількісного оцінювання ризику. Імовірнісний підхід. Обчислення абсолютного значення ризику.

Засоби управління ризиками. Основні підходи до управління ризиками. Способи зниження ступеня ризику. Обрання способу управління ризиком.

### **Математичні методи і моделі ринкової економіки**

Моделі економічного розвитку в ринковій економіці. Неоліберальна модель. Модель соціально орієнтованої ринкової економіки. Моделювання макроекономічного розвитку. Моделі планування японської економіки. Роль прогнозування в моделюванні економічних показників. Моделі макроекономічного розвитку України. Параметри й рівняння моделі.

Моделювання економічних показників на основі теорії сподівань. Адаптивні, наївні та раціональні сподівання. Модель інфляції Кейгана. Гіпотеза Фрідмена. Павутиноподібна модель.

Моделі адаптивного керування ринковою економікою. Роль чинника неповної інформації в управлінні підприємством. Поняття адаптивного управління. Пасивна й активна адаптація. Адаптивні моделі прогнозування інвестицій.

Поняття індикативного планування. Індикатори та регулятори. Етапи розроблення стратегії розвитку підприємства. Класифікація бюджетів.

Індикатори оцінювання діяльності підприємства. Моделі Альтмана, Ліса й Бівера. Рейтингове оцінювання діяльності підприємств.

Основні параметри планових рішень. Фактори, що впливають на реалізацію планових рішень. Інерційність та маневреність, планових рішень. Маневреність за базисом і маневреність за інтенсивністю. Ентропійні властивості планових рішень. Модель оптимізації планових рішень.

Поняття жорсткості та еластичності. Функція еластичності. Еластичність, актуальність і надійність планових рішень. Засоби керування жорсткістю та еластичністю. Оптимізація планів за еластичністю. Особливості оптимізації планів у ситуації інерційності. Особливості оптимізації планів у ситуації маневреності.

Поняття надійності планів. Визначення надійності планів. Зв'язок між надійністю, маневреністю та еластичністю. Засоби керування надійністю планових рішень. Теоретико-ігровий підхід до оцінювання надійності планів.

### **3. ПРОЦЕДУРА ПРОВЕДЕННЯ ВСТУПНОГО ІСПИТУ ТА СТРУКТУРА ЕКЗАМЕНАЦІЙНОГО БІЛЕТА**

Протягом двох астрономічних години здійснюється тестування з використанням стандартних білетів. Кожний студент вносить у бланк для відповідей свої реквізити і протягом 120 хвилин письмово дає відповіді на запитання білета.

Екзаменаційний білет містить три питання:

два питання із тематичних розділів програми;

третє питання: «Яке(і) основне(і) питання / проблема вирішена у Вашому науковому рефераті / останній науковій публікації? Чи пов'язане(а) воно(а) з передбачуваною темою дисертаційного дослідження?»

Проведення фахового вступного випробовування повинне ґрунтуватися на таких принципах:

уніфікація методики й умов проведення випробовування;

забезпечення інформаційної та психологічної підготовки студентів до випробовування;

зв'язок внутрішньовузівського контролю з галузевою системою атестації й ліцензування фахівців;

дотримання вимог секретності при використанні чи зберіганні матеріалів діагностики.

### **4. КРИТЕРІЇ ОЦІНЮВАННЯ ЗНАТЬ**

Головними професійними критеріями в процесі оцінювання знань та вмінь вступників є гнучкість концептуального мислення, вміння комплексно оцінювати управлінську ситуацію, точність аналітичного розв'язання, влучність і стислість виразу думки, вміння точно визначати економічну, соціальну та організаційну ефективність прийнятих рішень.

Характеристика оцінок:

Оцінка «**відмінно**» (5): відповідь повна і правильна, логічно викладена.

Оцінка «**добре**» (4): у цілому правильна відповідь з певною кількістю незначних неточностей та помилок.

Оцінка «**задовільно**» (3): відповідь повна, але неточна, зі значною кількістю недоліків.

Оцінка «**незадовільно**» (2): відповідь не задовольняє мінімальні критерії.

## 5. СПИСОК РЕКОМЕНДОВАНОЇ ЛІТЕРАТУРИ

1. Алдієва-Барановська. Глобальний бізнес: навчальний посібник – К.: ЦУЛ, 2013. – 560 с.
2. Амеліна І.В. Міжнародні економічні відносини: навчальний посібник. – К.: ЦУЛ, 2013. – 256 с.
3. Бобровнича Н.С., Борисевич Є.Г. Економетрія: навчальний посібник / Н.С. Бобровнича, Є.Г. Борисевич. – Одеса: ОНАЗ ім. О.С. Попова, 2010. – 180 с.
4. Васильєва Т.А., Леонов С.В., Кривич Я.М. Економічний ризик: методи оцінки та управління : навчальний посібник. – Суми : ДВНЗ «УАБС НБУ», 2015. – 208 с.
5. Вітлінський В.В. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком: навчальний посібник / В.В. Вітлінський, П.І. Верченко. – К.: КНЕУ, 2000. – 292 с.
6. Вітлінський В.В. Моделювання економіки: навчальний посібник. – К.: КНЕУ, 2012. – 408 с.
7. Вітлінський В.В., Піскунова О.В. Математичні моделі та методи ринкової економіки: навчальний посібник / М-во освіти і науки України, ДВНЗ «Київський нац. екон. ун-т ім. В. Гетьмана». – К. : КНЕУ, 2010. – 531 с.
8. Глобальна економіка: навчальний посібник для студентів зі спеціальностей «Економіка», «Маркетинг», «Облік і оподаткування» / за ред. проф. С. Архієреєва. – Харків : Видавництво Іванченка І. С., 2018. – 192 с. – укр. та англ. мовами.
9. Гребельник О.П. Основи зовнішньоекономічної діяльності: підручник. – К.: ЦУЛ, 2013. – 452 с.
10. Григорків В.С. Моделювання економіки: підручник / В.С. Григорків. – Чернівці : Чернівецький нац. ун-т ім. Ю. Федьковича, 2019. – 360 с.
11. Гронтковська Г.Е. Міжнародна економіка: навчальний посібник – К.: Кондор, 2014. – 382 с.
12. Джорж Р.Т. Ділова етика / Пер. з англ. Р.И. Стопера. / «Економічна школа», К., Вид. група «Прогрес», 2015. Т.1. – 220 с.
13. Економетрія. Частина 1 : [навчальний посібник] / А. О. Азарова, Н.В. Сачанюк-Кавецька, О.М. Роїк, Ю.В. Міронова. – Вінниця : ВНТУ, 2011. – 108 с.



14. Економетрія. Частина 2 : [навчальний посібник] / А.О. Азарова, Н.В. Сачанюк-Кавецька, О.М. Роїк, Ю.В. Міронова. – Вінниця : ВНТУ, 2011. – 118 с.
15. Заболоцький М.В., Прокопишин І.А. Основи фінансової математики: навчальний посібник. – Львів: ЛНУ імені І. Франка, 2016. – 144 с.
16. Ілляшенко С.М. Економічний ризик: навчальний посібник. – К.: Центр навчальної літератури, 2004. – 220 с.
17. Кінаш О.М., Сороківський В.М., Папка (Сороківська) М.В. Основи актуарних розрахунків. «Навчально-методичний посібник». – Львів: ЛНУ імені І. Франка, 2012. – 182 с.
18. Клебанова Т. С. Прогнозування соціально-економічних процесів: навчальний посібник для студентів напряму підготовки 6.030502 «Економічна кібернетика» денної форми навчання / Т. С. Клебанова, В. А. Курзенев, О.І. Черняк та ін. – Х. : ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2015. – 656 с.
19. Клебанова Т.С. Математичні методи і моделі ринкової економіки: [навчальний посібник] / Т.С. Клебанова, О.І. Черняк, М.О. Кизим. О.В. Раєвська та інші. – Харків : ВД «ІНЖЕК», 2010. – 456 с.
20. Ковтун І.О. Основи актуарних розрахунків: навчальний посібник / І.О. Ковтун, М.П. Денисенко, В.Г. Кабанов. – К.: ВД Професіонал, 2008. – 480 с.
21. Козьменко О.В. Актуарні розрахунки : навчальний посібник. – Суми : Університетська книга, 2014. – 224 с.
22. Корпоративна соціальна відповідальність: підручник / О. Гирик, О. Денис, О. Дубовик, І. Жеребило, А. Зінченко, Н. Реверчук, М. Саприкіна, Р. Семів, З. Скринник, К. Телюк; за заг.ред. д-ра екон. наук, проф. Т.С. Смовженко, д-ра екон.наук, проф.А.Я. Кузнецової/. – К.: УБС НБУ, 2015. – 110 с.
23. Котлер Ф., Н. Лі. Корпоративна соціальна відповідальність. Як зробити якомога більше добра для вашої компанії та суспільства / пер. з англ. С. Яринич. /– К.: Стандарт, 2015. – 302 с.
24. Кузьмичов А.І. Економетрія. Моделювання засобами MS Excel: [навчальний посібник] / А. І. Кузьмичов. – К. : ЦУЛ, 2011. – 214 с.
25. Куліш А. Соціальна відповідальність бізнесу в банківській сфері у запитаннях і відповідях / А. Куліш – К: 2014. – 150 с.
26. Лазоренко О. Корпоративна соціальна відповідальність в Україні: експертна думка: зб. статей та рекомендацій / О. Лазоренко / — К. : Стилос, 2015. – 110 с.
27. Лещинський О. Л. Економетрія / О. Л. Лещинський. – К. : МАУП, 2003. – 208 с.
28. Малиш Н.А. Моделювання економічних процесів ринкової економіки: Навчальний посібник – К.: МАУП, 2014. –120 с.
29. Осадець С.С. Страхування / Керівник авт. колективу і наук. ред. С.С. Осадець. – К., 2003. – 599 с.
30. Останкова Л. А., Шевченко Н. Ю. Аналіз, моделювання та управління економічними ризиками. Навч. посіб. – К.: Центр учбової літератури, 2011. – 256 с.

31. Соціальна відповідальність [Текст]: навчальний посібник / [О.Є. Кузьмін та ін.]; Нац. ун-т «Львів. Політехніка». – Львів: Вид-во Львів. політехніки, 2016. – 326 с.
32. Черняк О.І. Економетрика: підручник / О.І. Черняк, А.В. Ставицький, О.В. Баженова, О.В. Шобаніна; за ред. О.І.Черняка. – Миколаїв: МНАУ, 2014. – 414 с.

Склав  
завідувач кафедри економічної теорії  
та економічної кібернетики,  
д.е.н., професор



В.П. Дубіщев