

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ДЕРЖАВНИЙ ВИЩИЙ НАВЧАЛЬНИЙ ЗАКЛАД
ДОНЕЦЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ ТЕХНІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ

КАФЕДРА УПРАВЛІННЯ І ФІНАНСОВО-ЕКОНОМІЧНОЇ БЕЗПЕКИ

**МЕТОДИЧНІ РЕКОМЕНДАЦІЇ
ДО ВИКОНАННЯ КУРСОВОЇ РОБОТИ З ДИСЦИПЛІНИ
«Ризик-менеджмент»**

для студентів ОС «Бакалавр» всіх форм навчання
галузі знань

07 Управління та адміністрування

073 Менеджмент

Покровськ – 2021

УДК

Методичні рекомендації до виконання курсової роботи з дисципліни «Ризик-менеджмент» спеціальність 073 Менеджмент. / Укл. Мирошніченко Г.Б. – Покровськ: ДонНТУ, 2021. – 26с.

Методичні рекомендації до виконання курсової роботи з дисципліни «Ризик-менеджмент» містять методичні вказівки щодо виконання завдання з курсової роботи, умови написання та захисту, рекомендовану літературу; призначені для студентів спеціальності 073 «Менеджмент»

Укладачі: _____Мирошніченко Г.Б., доц., к.е.н., доц. кафедри управління і
(підпис) фінансово-економічної безпеки

Рецензент: _____Следь О.М., доц., к.е.н., доц. кафедри економіки
(підпис) підприємства

Відповідальний за випуск: _____Попова О.Ю., зав. кафедри
(підпис) управління і фінансово-економічної безпеки

Затверджено навчально–методичним відділом ДонНТУ,
протокол № від _____2021 р.

Розглянуто на засіданні кафедри управління і фінансово-економічної безпеки,
протокол № 7 від 28 лютого 2021 р.

© ДонНТУ, 2021 рік
© Мирошніченко Г.Б.,
2021рік

ЗМІСТ

ВСТУП	4
1 Мета та завдання курсової роботи	6
2 Загальні вимоги до курсової роботи	6
3 Вибір підприємства для курсової роботи	7
4 Структура та зміст курсової роботи	7
5 Вимоги до структурних елементів ввідної частини	7
5.1 Титульний лист	7
5.2 Реферат	8
5.3 Зміст	8
5.4 Вступ	8
5.5 Сутність роботи	9
5.6 Висновки	15
5.7 Перелік посилань	15
5.8 Додатки	15
6. Перелік тем курсових робіт	16
7 Правила оформлення роботи	17
7.1 Загальні вимоги	17
8 Підбір літератури та інших матеріалів з теми курсової роботи	18
9 Порядок захисту курсової роботи	19
10 Список ррекомендованої літератури	20
Додаток А	22
Додаток Б	23
Додаток В	24
Додаток Г	25

ВСТУП

Сучасний менеджмент характеризується прийняттям управлінських рішень в умовах нестабільного, навіть агресивного зовнішнього середовища. Успішна діяльність підприємств в умовах конкуренції все більш залежить від стратегічних дій, які будуть обрані керівництвом щодо мінімізації ризикових ситуацій як у внутрішньому середовищі, так і зовнішнього середовища.

Наявність ризиків як складової частини ділової діяльності призвело до необхідності розробки конкретних методів і прийомів їх виявлення при прийнятті та реалізації управлінських рішень. Компанії працюють в різних конкурентних середовищах з різними внутрішніми середовищами, виробничими можливостями, працівниками тощо. У зв'язку з цим кожна компанія має ризики, які безпосередньо притаманні цій компанії і пов'язані зі специфікою виробництва, технології, торгівлі, фінансів та інших видів діяльності. Важливо своєчасно їх ідентифікувати та визначити ймовірність виникнення, час виникнення та можливу шкоду.

Методи управління ризиками, які широко використовуються в підприємницької діяльності, вважаються інструментом управління бізнесом. Багато з цих методів можна використовувати для зменшення ризиків у діяльності компаній різних галузей та видів бізнесу.

Професійний менеджер рівня «бакалавр» повинен володіти технологіями та методикою визначення та оцінки ризиків у діяльності організації, без яких ефективно управління підприємством у складних економічних умовах практично неможливо. У зв'язку з цим актуальність, своєчасність і перспективність узагальнення знань з «Ризик-менеджменту» у вигляді курсової роботи не викликає сумнівів.

Курсова робота – це самостійне навчально-наукове дослідження студента, яке виконується з метою закріплення, поглиблення і узагальнення знань, одержаних за час навчання, та їх застосування до вирішення конкретного фахового завдання. Курсова робота допомагає студентові систематизувати отримані теоретичні знання з вивченої дисципліни, перевірити якість знань та оволодіти первинними навичками проведення сучасних досліджень в отриманні максимального прибутку при оптимальному, прийнятному співвідношенні прибутку і ризику.

Завданням написання та захисту курсової роботи є придбання практичних навичок самостійного прийняття рішень для стратегічного управління організацією з ціллю одержання оптимальних результатів її виробничо-комерційної діяльності.

Успішне виконання студентом курсової роботи залежить від того, наскільки вони чітко уявляють собі основні вимоги щодо теоретичного рівня, змісту, структури, обсягу, форми викладання матеріалу та оформлення роботи. Тому ціллю даних методичних рекомендацій є допомога студентам у виборі тематики та структури курсової роботи, недопущення помилок в її оформленні, підвищення якості захисту роботи та встановлення вимог до обсягу й оформленню курсової роботи з дисципліни.

1 МЕТА ТА ЗАВДАННЯ КУРСОВОЇ РОБОТИ

Виконання курсової роботи з дисципліни «Ризик-менеджмент» є складовою частиною навчального процесу. Мета курсової роботи полягає в розширенні і поглибленні знань студентів з даної дисципліни, всебічному засвоєнні матеріалу та застосуванні його на практиці, у розвитку навичок самостійної роботи, опануванні умінням аргументувати власну точку зору, узагальнювати, систематизувати й аналізувати внутрішню та зовнішню інформацію, статистичні, фінансові та економічні показники.

У процесі написання курсової роботи студент має здійснити аналіз внутрішнього середовища підприємства, провести аналіз фінансового стану підприємства, оцінити ефективність діяльності підприємства в умовах багатокритеріальності, невизначеності та ризику.

В процесі виконання курсової роботи студент повинен самостійно знайти та вивчити спеціальну літературу з обраної теми, здійснити аналіз відповідних статистичних даних, показати вміння вирішувати завдання зі особливостей управління ризиками, визначення факторів, що впливають на ризик діяльності підприємства, застосовувати теоретичні положення у вирішенні конкретних питань управління ризиками підприємством.

2 ЗАГАЛЬНІ ВИМОГИ ДО КУРСОВОЇ РОБОТИ

Курсова робота – це самостійне науково-практичне дослідження, яке дає можливість оцінити якість знань студента, його вміння застосувати їх на практиці.

Матеріал курсової роботи має бути викладений відповідно до вимог законів формальної логіки – закону тотожності, закону суперечливості, закону достатнього обґрунтування. Виконуючи роботу, студент має навчитися користуватися спеціальною літературою, самостійно її аналізувати та робити узагальнення. Курсову роботу студент повинен виконувати на основі ретельного вивчення та узагальнення передового досвіду з питань стратегічного управління, висвітленого в літературних джерелах, обов'язковим є використання статистичних даних, наведених у науковій літературі, періодичній пресі та статистичних щорічних виданнях.

Результати дослідження мають бути викладені у вигляді висновків та пропозицій. Обсяг курсової роботи – 35-45 друкованих аркушів стандартизованої форми (включаючи таблиці, схеми, діаграми, графіки тощо). У готовому тексті не дозволяється робити правки, закреслення, вставки, а також скорочувати слова та використовувати аббревіатури (крім загально прийнятих).

3 ВИБІР ПІДПРИЄМСТВА ДЛЯ КУРСОВОЇ РОБОТИ

Для виконання роботи студенти самостійно обирають галузь та підприємство (організацію), як об'єкт курсової роботи. Головна відмінність курсових робіт студентів – це обране самостійно підприємство (організація) певної галузі. Бажано аналізувати підприємство, де студент попередньо проходив практику. Якщо це неможливо за будь-яких обставин, обрати підприємство можна за посиланням згідно www.smida.gov.ua.

4 СТРУКТУРА ТА ЗМІСТ КУРСОВОЇ РОБОТИ

Після вибору підприємства студент повинен розробити й викласти в письмовій формі її план. План теми слід розробляти після ознайомлення з літературними джерелами, які висвітлюють ті чи інші питання та проблеми теми дослідження. Це дасть змогу студенту детальніше уявити собі структуру роботи, послідовно викласти її зміст, повніше висвітлити коло питань, які мають бути вирішені.

Структура та зміст плану курсової роботи, співвідношення її розділів передбачає три розділи. План складається із розділів і підрозділів. Рекомендовано наступну схему плану.

Вступ – обґрунтування актуальності теми, визначення кола завдань курсової роботи та методів, які використовуються.

Розділ 1. Теоретичні основи ризик-менеджменту

Розділ 2. Аналіз техніко-економічного стану підприємства

Розділ 3. Методика обґрунтування управлінського рішення щодо мінімізації ризику діяльності підприємства.

Висновки.

Назву відповідних підрозділів за кожним розділом студент формулює самостійно.

5 ВИМОГИ ДО СТРУКТУРНИХ ЕЛЕМЕНТІВ РОБОТИ

5.1 Титульний лист

Титульний лист є першою сторінкою курсової роботи. Він містить наступні дані:

- 1) найменування міністерства;
- 2) найменування вищого навчального закладу;
- 3) назву кафедри;

- 4) повне найменування документу;
- 5) підписи керівника роботи та виконавця;
- 6) рік виконання роботи.

Приклад складання титульного листа наведено в **додатку А**.

5.2 Реферат

Реферат потрібен для ознайомлення з роботою. Він повинен бути коротким, інформативним та містити факти, що дозволяють прийняти рішення про доцільність читання всієї роботи.

Реферат міститься за листом завданням (**додаток Б**). Він повинен містити: дані про обсяг роботи (кількість сторінок, ілюстрацій, таблиць, додатків, джерел за переліком посилань), текст реферату, перелік ключових слів.

Текст реферату повинен містити інформацію надану в курсовій роботі в наступній послідовності: об'єкт дослідження, мета роботи, методи дослідження, результати та їх новизна, економічна ефективність. Реферат необхідно виконувати обсягом не більшим за 500 слів на одній сторінці формату А4. Ключові слова містять після тексту реферату. Перелік ключових слів від 5 до 15, написаних великими буквами в називному відмінку через кому в строку. Приклад складання реферату наведено в **додатку В**.

5.3 Зміст

Зміст містять безпосередньо після реферату, починаючи з нової сторінки. Зміст складають, якщо робота містить не менш ніж два розділи, або один розділ та додаток при загальній кількості сторінок не менш 10. Він включає:

- вступ;
- послідовно перелічені найменування всіх розділів, підрозділів;
- висновки;
- перелік посилань;
- найменування додатків.

У змісті обов'язково вказуються номери сторінок, на яких міститься початок матеріалу.

5.4 Вступ

У вступі коротко викладають: оцінку сучасного стану проблеми, відмічаючи при цьому практично вирішенні в роботі задачі, існуючі проблеми знань в даній предметній області, актуальність даної роботи, мету роботи та область застосування. Вступ розміщують на окремій сторінці.

5.5 Сутність роботи

При викладенні матеріалу необхідно обґрунтувати актуальність обраної теми; розкрити теоретичну значимість питань, що розглядаються в курсовій роботі; зробити аналіз фактичного матеріалу, який допоможе з'ясувати проблеми, що стосуються обраної теми; обґрунтувати шляхи їх вирішення; зробити відповідні висновки.

Розділ 1. Теоретичні основи визначення і оцінювання ризиків.

У цьому розділі слід розкрити основні поняття та сутність ризик-менеджменту сутність визначення місії та цілей розвитку підприємства, В цьому розділі повинно бути приведена характеристика господарського рішення, яке мінімізує ймовірність ризику господарської діяльності підприємства і визначає напрямки його впливу на підвищення ефективності господарської діяльності підприємства.

Розділ 2. Аналіз техніко-економічного стану господарського суб'єкту.

У першому підрозділі даного розділу необхідно розкрити, якими видами діяльності займається підприємство. та навести характеристику його внутрішнього середовища.

Загальні характеристики підприємства (імідж підприємства, конкурентоспроможність, рівень спеціалізації, капітало-, науко-, трудомісткість та ін.).

Провести аналіз основних техніко-економічних показників підприємства.

У другому підрозділі даного розділу необхідно провести аналіз фінансового стану підприємства, аналіз матеріального забезпечення, аналіз основних та оборотних фондів підприємства

У третьому підрозділі студент повинен на основі проведеного аналізу визначити резерви підвищення ефективності діяльності підприємства з використанням теорій ризику.

Розділ 3. Методика обґрунтування управлінського рішення щодо мінімізації ризику діяльності підприємства.

У першому підрозділі студент повинен виходячи з обраного резерву підвищення ефективності діяльності підприємства запропонувати оцінку ризику, що пов'язан з реалізацією даного рішення.

У другому підрозділі студент наводить рекомендовані заходи щодо впровадження управлінського рішення, щодо мінімізації господарської діяльності (фінансової, інвестиційної, операційної) підприємства

У таблиця 5.1. наведено основні формули щодо визначення кількісної оцінки ризику.

Таблиця 5.1. – Показники кількісної оцінки ризику.

Група та назва показника	Розрахункова формула	Критерій оцінки ризику
Абсолютні показники		
Ризик альтернативного рішення	$R = X_H * P_H \quad (1)$	$> \min$
Математичне сподівання	$M(x) = \sum_{i=1}^n X_i \cdot P_i \quad (2)$ $M(x) = \int_{-\infty}^{+\infty} f(x) dx \quad (3)$	$> \min$ (очікувані втрати) $> \max$ (очікувані доходи)
Дисперсія	$\sigma^2 = \sum_{i=1}^n (x_i - M(x))^2 \cdot P_i \quad (4)$ $\sigma^2 = \int_{-\infty}^{+\infty} (x - M(x))^2 f(x) dx \quad (5)$	$> \min$
Показники, що характеризують функцію щільності розподілу ймовірностей розподілу випадкових втрат		
Показник допустимого ризику	$W(x) = 1 - \int_{-\infty}^{x_{доп}} f(x) dx \quad (6)$	$< 0,1$
Показник критичного ризику	$W(x) = 1 - \int_{x_{доп}}^{x_{кр}} f(x) dx \quad (7)$	$< 0,01$
Показник катастрофічного ризику	$W(x) = 1 - \int_{x_{ф}}^{x_{кат}} f(x) dx \quad (8)$	$< 0,001$
Відносні показники ризику		
Коефіцієнт варіації	$Cv = \frac{\sigma}{M(x)} \quad (9)$	$< 0,33$
Коефіцієнт ризику	$W = \frac{X}{K} \quad (10)$	$> \min$

У таблиці 5.2. наведені формули для розрахунку ступеня ризику інвестиційних проектів.

Найбільш розповсюдженим методом оцінки ризику є імовірнісний підхід. Оцінюючи імовірності можливих ризиків і наслідки їхньої реалізації на практиці, дослідник отримує найбільш повну картину.

Задача зводиться до визначення очікуваної *ONPV* проекту:

Таблиця 5.2. – Формули для оцінки інвестиційних ризиків.

Чиста сучасна вартість $NPV = \sum_{t=0}^T \frac{CF_t}{(1+R)^t}$	де CF_t – чистий (нетто) потік доходів (видатків у t – му році); T – кількість розрахункових років; R – норма (ставка) дисконту з урахуванням ризиків та інфляції.
Очікувана сучасна вартість проекту: $ONPV = \sum_{t=0}^T \frac{CF_t}{(1+R)^t} * P_i$	P_i - імовірність настання i -го випадку ($\sum P_i = 1$); m -кількість розглянутих випадків. Чим менше значення стандартного відхилення, тим менший ризик інвестиційного проекту.
Стандартне відхилення проектів $\sigma = \sqrt{\sum_{i=1}^m (NPV_i - ONPV)^2 * P_i}$	P_i - імовірність настання i -го випадку
коли ОЧСВ і σ за проектами, що порівнюються, мають істотні різниці	
коефіцієнт варіації проектів: $K_{\text{вар}} = \frac{\sigma}{ONPV}$	

Для оцінки ймовірності банкрутства підприємства використовуються теорія Терещенко О.О., яким було обґрунтовано новий методологічний підхід до діагностики банкрутства вітчизняних підприємств, в основу якого покладено мультиваріантний дискримінантний аналіз. Суттєвою перевагою зазначеного переходу є врахування галузевих особливостей об'єктів дослідження при побудові дискримінантних моделей діагностики банкрутства (таблиця 5.3.).

Інтерпретація моделі:

$Z > 2$ — підприємство вважається фінансово стійким, і тому йому не загрожує банкрутство;

$1 < Z < 2$ - фінансова рівновага (фінансова стійкість) підприємства порушена, але за умови переходу на антикризове управління банкрутство йому не загрожує;

$0 < Z < 1$ — підприємству загрожує банкрутство, якщо воно не здійснить санаційних заходів;

$Z < 0$ — підприємство є напівбанкрутом

Таблиця 5.3. – Дискримінантні моделі діагностики банкрутства

Групи видів економічної діяльності	Дискримінанта модель
Сільське господарство	$Z = 0,105X_1 + 1,567X_2 + 0,301X_3 + 1,375X_4 + 1,689X_8 + 0,168X_9 - 0,260$
Харчова промисловість	$Z = 0,261X_1 + 1,272X_2 + 0,13X_3 + 0,486X_4 + 0,639X_9 + 0,221X_{10} - 1,433$
Інші галузі обробної промисловості	$Z = 0,139X_1 + 1,535X_2 + 0,486X_3 + 1,459X_4 + 0,265X_9 + 0,159X_{10} - 1,757$
Добувна промисловість, металургія, машинобудування, виробництво електроенергії, газу, води	$Z = 0,213X_1 + 2,208X_2 + 0,67X_3 + 1,13X_4 + 1,48X_5 + 0,515X_8 + 0,467X_{10} - 2,599$
Будівництво	$Z = 0,333X_1 + 1,458X_2 + 0,395X_4 + 1,407X_5 + 0,040X_6 + 0,41X_{10} - 2,325$
Оптова та роздрібна торгівля, готелі та ресторани	$Z = 0,268X_1 + 1,773X_2 + 1,478X_4 + 0,775X_5 + 0,028X_6 + 0,097X_9 + 0,177X_{10} - 2,026$
Транспорт	$Z = 0,145X_1 + 1,481X_2 + 1,007X_4 + 0,048X_6 + 0,146X_{10} - 1,779$
Інші види діяльності	$Z = 0,306X_1 + 0,331X_2 + 1,309X_4 + 0,050X_6 + 0,363X_9 + 0,258X_{10} - 1,387$
де X_1 — коефіцієнт покриття (поточні активи/поточні зобов'язання)	
X_2 — коефіцієнт фінансової незалежності (власний капітал/валюту балансу)	
X_3 — коефіцієнт оборотності капіталу (чиста виручка від реалізації/валюта балансу)	
X_4 — коефіцієнт рентабельності операційних продаж cash-flow 1 (cash-flow 1	

/(чиста виручка від реалізації + інші операційні доходи))
X ₅ — коефіцієнт рентабельності активів по cash-flow 2 (cash-flow 2/валюта балансу)
X ₆ — коефіцієнт оборотності позичкового капіталу (чиста виручка від реалізації/позичковий капітал)
X ₇ - відношення cash-flow 1 до позичкового капіталу
X ₈ — рентабельність продажів (прибуток (збиток) до оподаткування/чиста виручка від реалізації)
X ₉ — рентабельність власного капіталу (прибуток (збиток) після оподаткування/власний капітал)
X ₁₀ — коефіцієнт оборотності оборотних активів (чиста виручка від реалізації/середні залишки оборотних активів)

Ризики операційної діяльності підприємства вимірюються як ризик настання втрат. Способи розрахунку очікуваних, максимальних та мінімальних імовірних втрат однакові.

Таблиця 5.4. – Формули для оцінки операційних ризиків.

від можливого зниження обсягу виробництва і реалізації продукції: $B_p = \sum_{i=1}^n \text{ВП}_{\text{бі}} (\text{Ц}_i - \text{ЗЗ}_i),$	Вр — втрати від ризику, спричиненого можливим зниженням обсягу виробництва і реалізації продукції; ВПбі — імовірне зменшення обсягу виробництва і реалізації і-го виду продукції у натуральному виразі; Ці — ціна за одиницю і-го виду продукції; ЗЗ> — розмір змінних витрат на одиницю і-го виду продукції; п — кількість і-х видів продукції;
від імовірного зниження цін: $B_{p, \text{ц}} = \sum_{i=1}^n \Delta \text{Ц}_i \cdot \text{ВП}_i,$	Вр.ц — втрати від ризику, пов'язаного з можливим зниженням цін; ЛЦ — імовірне зниження ціни одиниці і-го виду продукції; ВПі — запланований обсяг випуску і реалізації і-го виду продукції;
від можливої перевитрати фонду споживання:	де Вр.с — втрати від ризику, який може спричинити перевитрату фонду

$B_{p.c} = \Phi C_{\phi} - \Phi C_{\Pi} = \Delta B_c \cdot \text{ЧП} + \Delta \text{ЧП} \cdot B_c,$	споживання; ΦC_{ϕ} — розмір фонду споживання з урахуванням імовірної дії негативних чинників; ΦC_{Π} -- плановий розмір фонду споживання; ΔB_c - імовірне перевищення середніх виплат на одного працівника з фонду споживання порівняно із запланованим рівнем унаслідок проведення ризикованих операцій; ЧП - планова чисельність працівників; $\Delta B_c \cdot \text{ЧП}$ - імовірна перевитрата фонду споживання за рахунок перевищення середніх виплат на одного працівника; $\Delta \text{ЧП}$ - імовірне перевищення чисельності працівників порівняно з її плановою кількістю внаслідок проведення ризикованих операцій; B_c - середні очікувані виплати з фонду споживання на одного працівника; $\Delta \text{ЧП}$, B_c - імовірна перевитрата фонду споживання за рахунок перевищення чисельності працівників;
від імовірної перевитрати матеріально-сировинних і паливно- енергетичних ресурсів: $B_{p.m} = M_{\phi} - M_{\Pi} = \sum_{i=1}^k \Delta M_i \cdot \Pi_i + \sum_{i=1}^k M_i \cdot \Delta \Pi_i,$	$B_{p.m}$ - втрати від ризику, який може призвести до перевитрати матеріально-сировинних і паливно-енергетичних ресурсів; M_{ϕ} - імовірні очікувані витрати матеріально-сировинних і паливно-енергетичних ресурсів на заданий обсяг виробництва продукції у вартісному виразі; M_{Π} - планові витрати матеріально-сировинних і паливно-енергетичних ресурсів на заданий обсяг виробництва продукції у вартісному виразі; ΔM_i — імовірна перевитрата i-х видів матеріально-сировинних і паливно-енергетичних ресурсів у натуральному виразі на заданий обсяг виробництва продукції; Π - початкова (планова) ціна одиниці i-х видів ресурсів; M_i - планові витрати i-х видів матеріально-сировинних і паливно-енергетичних ресурсів на заданий обсяг виробництва продукції у натуральному виразі; $\Delta \Pi_i$ - імовірне зростання ціни одиниці i-х

	видів ресурсів; k - кількість i -х видів матеріально-сировинних і паливно-енергетичних ресурсів; $\xi_{ДМі}$, Π_i - імовірна перевитрата матеріально-сировинних і паливно-енергетичних ресурсів у вартісному виразі за рахунок можливого зростання цін;
унаслідок можливої безгосподарності: $B_{p,r} = \sum_{i=1}^l B_i,$	$B_{p,r}$ - витрати від ризику, спричиненого можливими наслідками безгосподарності; B_i - імовірні втрати від i -го виду безгосподарності (псування товарно-матеріальних цінностей, їх нестача від природних втрат, сплата штрафів тощо); l - кількість різновидів безгосподарності;

5.6 Висновки

Висновки містять безпосередньо після викладання сутності роботи на новій сторінці. Висновки є завершальним етапом виконаної студентом курсової роботи. Вони повинні містити короткі підсумки за результатами теоретичного та практичного аналізу об'єкта дослідження з наведенням запропонованих заходів щодо мінімізації впливу ризику на господарську діяльність підприємства.

5.7 Перелік посилань

Перелік джерел, на які посилаються в основній частині курсової роботи повинен бути наведений в кінці роботи, починаючи з нової сторінки. В відповідних місцях тексту повинні бути посилання. Література нумирується по ходу посилань на неї, починаючи з першого посилання й далі по порядку. Якщо джерелу посилання вже присвоєно номер, то він використовується у подальшому.

Порядкові номери описань літературних джерел в переліку повинні співпадати з номерами посилань в тексті. Бібліографічні описання посилань в переліку наводять відповідно до діючих стандартів по бібліотечній та видавничій справі. Якщо з одного літературного видання використовується кілька статей, то в переліку посилань кожна стаття вказується окремо та має власний номер.

5.8 Додатки

В додатках містять матеріал, що:

– є необхідним для повноти роботи, але включення його в основну частину роботи може змінити упорядковане та логічне уявлення про роботу;

– не може бути послідовно розміщений в основній частині роботи через великий обсяг.

В додатках можуть бути включені додаткові ілюстрації чи таблиці, оригінали фотографій, формули, розрахунки, анкети та ін.

6. ПЕРЕЛІК ТЕМ КУРСОВИХ РОБІТ

Вибір теми курсової роботи здійснюється по номеру останній цифрі залікової книжки.

1. Методи управління операційними ризиками на підприємстві.
2. Ризики в управлінні запасами підприємства.\
3. Стратегія управління ризиками у фінансовій діяльності підприємства
4. Ризик позиція підприємства та особливості її прояву в діяльності підприємства.
5. Формування системи управління ризиком на підприємстві.
6. Вплив зовнішнього оточення підприємства на мінімізацію економічних ризиків.
7. Організаційні методи мінімізації економічного ризику.
8. Хеджування в управлінні витратами підприємства.
9. Оцінка ризику кредитного портфелю.
10. Підвищення фінансової стійкості підприємства як засіб мінімізації економічних ризиків.
11. Виявлення фінансових резервів підприємства як засіб профілактики економічних ризиків.
12. Вибір оптимальної стратегії в умовах ризику, пов'язаного з невизначеністю навколишнього середовища.
13. Управління ризиками в інвестиційній діяльності підприємства.
14. Управління ризиками в операційній діяльності підприємства.
15. Управління виробничими ризиками на підприємстві.
16. Аналіз та оцінка екологічних ризиків підприємства.
17. Управління ймовірністю ризику банкрутства підприємства.
18. Управління портфельним ризиком у банку.
19. Ф'ючерсні операції як метод мінімізації ризику діяльності підприємства.
20. Оцінка управлінських рішень в умовах невизначеності.
21. Моделі кількісного аналізу кредитного ризику комерційного банку.

22. Моделі кількісного аналізу ризиків у зовнішньоекономічній діяльності.
23. Моделі оцінки кредитоспроможності позичальника та ризику банку.
24. Моделі портфельного підходу в теорії грошей з використанням функцій корисності.
25. Моделі прогнозування валютних курсів та валютного ризику.

7. ПРАВИЛА ОФОРМЛЕННЯ РОБОТИ

7.1 Загальні вимоги

Роботу складають у вигляді тексту, ілюстрацій, таблиць та оформлюють на аркушах формату А4 (210х297 мм) друкованим засобом на одній сторінці аркушу білого паперу. Використовують шрифт Times New Roman, 14 пт, інтервал – 1,5, абзацний відступ - 1,25, без переносів слів. В роботі слід використовувати одиниці SI. Текст роботи слід оформлювати, дотримуючись наступних розмірів полів: верхнє, ліве та нижнє – 20 мм, праве – 10 мм. Загальний обсяг курсової роботи має бути в межах 40-50 сторінок друкованого тексту. Курсова робота виконується українською мовою.

8 ПІДБІР ЛІТЕРАТУРИ ТА ІНШИХ МАТЕРІАЛІВ З ТЕМИ КУРСОВОЇ РОБОТИ

Після складання плану і погодження його з науковим керівником необхідно з'ясувати стан вивчення обраної теми сучасною наукою, аби конкретніше визначити напрями дослідження та основні питання курсової роботи.

Навчальну та спеціальну літературу з теми курсової роботи студент добирає самостійно, використовуючи для цього алфавітний предметний та систематизований каталоги, які є в кожній бібліотеці. Консультацію з питань добору літератури студент може отримати у викладача кафедри чи у працівника бібліотеки.

Під час добору літератури особливу увагу слід звернути на першоджерела, що стосуються теми, періодичні видання, наукові статті, передовий виробничий досвід.

Наступний етап – складання бібліографії (списку літературних джерел). Передусім слід звернути увагу на рік видання того чи іншого літературного джерела. Користуватися необхідно лише новими виданнями. Обов'язково слід вивчити та використати у процесі написання курсової роботи нормативні акти (закони, декрети, постанови тощо), що стосуються обраної теми.

Зібраний статистичний матеріал необхідно ретельно опрацювати, згрупувати, класифікувати, звести у таблиці, зробити порівняльний аналіз. Подати ці матеріали можна також у вигляді діаграм, графіків, картограм, схем та ін.

9 ПОРЯДОК ЗАХИСТУ КУРСОВОЇ РОБОТИ

Курсова робота повинна бути літературно та технічно грамотно виконана та відповідати вимогам оформлення. Курсова робота повинна бути зброшурована.

Робота має бути виконана і подана на кафедру не пізніше ніж за 2 тижні до екзамену. Захист роботи повинен відбутись перед комісією. Узагальнені критерії оцінювання якості виконання курсової роботи та деталізовані бальні шкали наведено в додатку Г.

СПИСОК РЕКОМЕНДОВАНОЇ ЛІТЕРАТУРИ

1. Вітлінський В. В. Аналіз, оцінка і моделювання економічного ризику. К.: Деміур, 1996. 212 с.
2. Вітлінський В. В., Великоіваненко Г. І. Ризикологія в економіці та підприємстві: Монографія. К.: КНЕУ, 2004. 480 с.
3. Вітлінський В. В., Верченко П. І. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком: Навч.-метод. посібник для самост. вивч. дисц. К.: КНЕУ, 2000. 292 с.
4. Вітлінський В. В., Наконечний С. І. Ризик у менеджменті. К.: Борисфен-М, 1996. 336 с.
5. Вітлінський В. В., Наконечний С. І., Шарапов О. Д. Економічний ризик і методи його вимірювання: Підручник. К.: ІЗМН, 2000.
6. Грабовый П. Г., Петрова С. Н., Полтавцев С. И. и др. Риски в современном бизнесе. М.: Аланс, 1994. 200 с.
7. Економічний ризик: ігрові моделі: Навч. посібник / В. В. Вітлінський, П. І. Верченко, А. В. Сігал, Я. С. Наконечний; за ред. В. В. Вітлінського. К.: КНЕУ, 2002. 446 с.
8. Подольська А. О., Яріш О. В. Фінансовий аналіз: Навч. посібник. К.: Центр навчальної літератури, 2007 р. 488 с.
9. Костриченко В.А. Методичні вказівки до виконання курсової роботи з дисципліни «обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків. – Рівне, НУВГП, 2012. 36 с.
10. Критерії і показники підприємницького ризику. Назва з екрану. URL: <https://pefa.kiev.ua/kryteriyi-ta-pokaznyky-pidpryyemnytskogo-ryzyku/>
11. Мороз, В.М. Ризик-менеджмент : навч. посіб. : для студ. спец. 281- "Публічне управління та адміністрування" спеціалізації "Адміністративний менеджмент" К. : Кондор, 2019 . 140 с.
http://repository.kpi.kharkov.ua/bitstream/KhPI-Press/39143/1/Book_2018_Moroz_Ryzyk_menedzhment.pdf

12. Азаренкова Г. М. Аналіз моделювання і управління ризиком (в схемах та прикладах) : навч. Посібник. Львів : Новий світ-2000, 2011. 240 с

13. Донець Л. І. Економічні ризики та методи їх вимірювання : [навч. посіб.] / Л. І. Донець. Київ : Центр навчальної літератури, 2006. 312 с.

14. 3. Старостіна А. О. Ризик-менеджмент: теорія та практика : навч. посібник / А. О. Старостіна, В. А. Кравченко. Київ: Політехніка, 2004. 200 с.
<https://subject.com.ua/pdf/311.pdf>

1.

Додаток А

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ДЕРЖАВНИЙ ВИЩИЙ НАВЧАЛЬНИЙ ЗАКЛАД
ДОНЕЦЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ ТЕХНІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
КАФЕДРА УПРАВЛІННЯ І ФІНАНСОВО-ЕКОНОМІЧНОЇ БЕЗПЕКИ

КУРСОВА РОБОТА

з дисципліни «Ризик-менеджмент»

на тему «_____»

Студента _____ курсу,
_____ групи

(прізвище, ім'я та по батькові)

№ залікової книжки _____

(підпис)

Дата здачі роботи на
перевірку та рецензування _____

Консультант:

Курсова робота
захищена з оцінкою «_____»

(прізвище, ім'я та по батькові)

Дата захисту _____

(підпис)

Покровськ, 202_

**ДЕРЖАВНИЙ ВИЩИЙ НАВЧАЛЬНИЙ ЗАКЛАД
ДОНЕЦЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ ТЕХНІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ**

Кафедра управління і фінансово-економічної безпеки

Дисципліна «сучасні управлінські технології»

Галузь знань _____

Курс _____ Група _____ Семестр _____

ЗАВДАННЯ

на курсову роботу студента

(прізвище, ім'я, по батькові)

1. Тема роботи _____

Термін здачі студентом закінченої роботи _____

2. Вихідні дані до роботи _____

3. Зміст пояснювальної записки (перелік питань, що підлягають розробці) _____

4. Дата видачі завдання _____

Студент _____
(підпис)

Керівник _____
(підпис)

«__» _____ 20__ р.

РЕФЕРАТ

Курсова робота містить: ____ стор., __ рис., __ табл., ____джерел, ____ додатків

Об'єкт дослідження –

Предмет дослідження –

Мета дослідження –

Методи дослідження:

В курсовій роботі проаналізовано теоретичні основи ризик менеджменту в сучасних умовах діяльності....., аналізу впливу факторів внутрішнього та зовнішнього середовища на результати діяльності підприємства , визначено ризики діяльності підприємства, запропоновані заходи, щодо мінімізації ризику діяльності підприємства

РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТ, ФІНАНСОВИЙ-АНАЛІЗ, БАНКРУТСТВО, ЕФЕКТИВНІСТЬ, ВИРОБНИЙ РИЗИК, ОПЕРАЦІЙНИЙ РИЗИК, ФІНАНСОВИЙ РИЗИК, ІНВЕСТИЦІЙНИЙ РИЗИК.

Параметри та критерії оцінювання курсової роботи

Параметри оцінювання	Діапазон оцінки, балів	Критерії оцінювання за бальною шкалою
Оцінювання якості курсової роботи	0 - 75	
1.Відповідність змісту курсової роботи темі та затвердженому плану	0-15	0 – зміст жодного з параграфів курсової роботи не відповідає затвердженому плану
		5 - зміст одного параграфу курсової роботи відповідає затвердженому плану
		10 - зміст двох параграфів курсової роботи відповідає затвердженому плану
		15 - зміст усіх параграфів курсової роботи відповідає затвердженому плану
2.Ступінь розкриття теоретичних аспектів проблеми, обраної для дослідження, та коректність використання понятійного апарату	0-15	0 – понятійний апарат не сформовано; теоретичні аспекти проблеми не розкриті
		5 – понятійний апарат сформовано, але теоретичні аспекти проблеми не розкриті
		10 - понятійний апарат сформовано, теоретичні аспекти проблеми розкриті частково
		15 - понятійний апарат сформовано, теоретичні аспекти проблеми розкриті
3.Наявність критичних співставлень та узагальнень різних точок зору та підходів до постановки та розв’язання проблеми	0-15	0 – критичні співставлення та узагальнення відсутні
		10 - критичні співставлення наявні, але узагальнення відсутні або некоректні
		15 - критичні співставлення наявні та супроводжені коректними узагальненнями
4.Ступінь використання фактологічного матеріалу; висвітлення особливостей прояву та розв’язання досліджуваної проблеми у практиці вітчизняних підприємств	0-10	0 – фактологічний матеріал не використаний
		5 - залучений фактологічний матеріал, особливості прояву та розв’язання проблеми на вітчизняних підприємствах не висвітлені
		10 - залучений фактологічний матеріал, досвід вітчизняних підприємств висвітлений
5.Обсяг та адекватність використаних при написанні роботи першоджерел та дотримання етики посилань	0-10	0 – залучені матеріали лише навчальних підручників та посібників (до 10 джерел), етика посилань не дотримана
		5 - залучені матеріали навчальних підручників та посібників, періодичних видань (11-15 джерел), етика посилань дотримана частково
		10 – залучені матеріали навчальних підручників та посібників, монографій, статистичних збірників та довідників, періодичних видань та мережі Internet (більше 15 джерел), етика посилань дотримана

Продовження табл.

Параметри оцінювання	Діапазон оцінки, балів	Критерії оцінювання за бальною шкалою
6.Відповідність оформлення курсової роботи встановленим вимогам	0-10	0 – текст курсової роботи оформлено з суттєвими порушеннями встановлених вимог
		5 - текст курсової роботи оформлено з незначними порушеннями встановлених вимог
		10 - текст курсової роботи оформлено у відповідності до встановлених вимог
Оцінювання захисту курсової роботи	0 – 25	
7.Вміння чітко та стисло викласти основні результати дослідження	0-15	0 – студент неспроможний чітко та стисло викласти основні результати дослідження
		5 – студент невпорядковано викладає основні результати дослідження
		15 – студент спроможний чітко та стисло викласти основні результати дослідження
8.Повнота, глибина, обґрунтованість відповідей на питання	0-10	0 – студент неспроможний надати відповіді на поставлені питання
		5 - студент надає неповні, поверхові, необґрунтовані відповіді на поставлені питання
		10 – студент надає повні, глибокі, обґрунтовані відповіді на поставлені питання

Примітка: Додатковим критерієм оцінювання якості курсової роботи (+ 15 балів) є наявність елементів наукової новизни та оригінальність методів дослідження за умови, що загальна сума балів оцінки якості роботи не перевищує 75 балів

