

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ

НАЦІОНАЛЬНИЙ ТЕХНІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
«ХАРКІВСЬКИЙ ПОЛІТЕХНІЧНИЙ ІНСТИТУТ»

МЕТОДИЧНІ ВКАЗІВКИ

до самостійної роботи

з навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент»

для студентів галузі знань 07 «Управління та адміністрування» спеціальності
073 «Менеджмент» освітньо-кваліфікаційного рівня магістр
усіх форм навчання

Затверджено
редакційно-видавничою
радою університету,
протокол № 2 від 27 червня 2024 р.

Харків
НТУ «ХПІ»
2024

Ризик-менеджмент: методичні вказівки до самостійної роботи з навчальної дисципліни для студентів галузі знань 07 «Управління та адміністрування» спеціальності 073 «Менеджмент» освітньо-кваліфікаційного рівня магістр усіх форм навчання / укл. Н. Шиян. – Харків: НТУ «ХПІ», 2024. – 24 с.

Укладач: Н. ШИЯН

Рецензент: І. ІППОЛІТОВА

Кафедра менеджменту

ВСТУП

Самостійна робота студента (СРС) – це самостійна діяльність та навчання студента, яку науково-педагогічний працівник планує разом зі студентом, але виконує її студент за завданнями та керівництвом і контролем науково-педагогічного працівника без його прямої участі.

1. ФОРМИ САМОСТІЙНОЇ РОБОТИ СТУДЕНТІВ

1. Робота із навчальною, науковою, науково-популярною та довідковою літературою.
2. Написання рефератів.
3. Підготовка доповідей.
4. Проведення дискусій.
5. Розв'язання проблемних і творчих питань.
6. Самостійна робота студентів в інформаційній мережі Internet.

2. ОРГАНІЗАЦІЯ І КОНТРОЛЬ САМОСТІЙНОЇ РОБОТИ СТУДЕНТІВ

Організація самостійної роботи студентів з дисципліни здійснюється відповідно до плану вивчення навчальної дисципліни і містити:

- перелік видів і форм самостійної роботи, що практикуються протягом всього терміну вивчення дисципліни;
- кількість та обсяг завдань для самостійного роботи;
- строки їх виконання;
- кількість і час проведення відповідних контрольних заходів.

Види контролю:

1. Попередній («вхідний») контроль знань і вмінь студентів, який проводиться на початку вивчення дисципліни.

2. Поточний контроль дозволяє регулярно відслідковувати якість засвоєння лекційного матеріалу і здійснюється переважно на семінарських заняттях.

3. Проміжний контроль практикується по закінченні вивчення великого розділу курсу.

4. Самоконтроль – повинен проводитися особисто студентом під час підготовки до контрольних заходів протягом усього часу вивчення дисципліни.

5. Індивідуальні консультації щодо розгляду того чи іншого завдання.

Форми контролю за виконанням самостійної роботи студентів:

- опитування,
- самостійні та контрольні роботи,
- захист рефератів,
- колоквіум,
- тестовий контроль
- залік / іспит.

Оцінка самостійної роботи студентів відбувається відповідно до Положень з навчальної роботи НТУ «Харківський політехнічний інститут».

З дисципліни «Ризик-менеджмент» самостійна робота студентів представлена у вигляді: підготовки рефератів (за темами навчальної дисципліни); тем для виступів студентів із доповідями; проблемних питань і завдань; тем для дискусій.

3. ЗАВДАННЯ ДЛЯ САМОСТІЙНОГО ВИКОНАННЯ СТУДЕНТАМИ

3.1. Теми рефератів

Тема 1. Сутність та зміст ризик-менеджменту

Теми для самостійної роботи

1. Наукові погляди засновників і представників класичної і неокласичної шкіл політекономії у розумінні змісту теорії ризику.
2. Етапи становлення і розвитку ризик-менеджменту.
3. Етапи розвитку ризик-менеджменту.

4. Ризик-менеджер в організації.
5. Ключові моменти традиційної концепції ризик-менеджменту.
6. Ключові аспекти корпоративної концепції ризик-менеджменту.

Список рекомендованої літератури

1. Мороз В.М., Мороз С.А. Ризик-менеджмент : навч. посібник для студ. спец. 281 «Публічне управління та адміністрування». Харків : НТУ «ХП», 2018. 140 с.
2. Боровик М. В. Ризик-менеджмент : конспект лекцій для студентів магістратури усіх форм навчання спеціальності 073 «Менеджмент». Харків. нац. ун-т міськ. госп-ва ім. О. М. Бекетова. Харків : ХНУМГ ім. О. М. Бекетова, 2018. 65 с.
3. Horkin P. Fundamentals of Risk Management: Understanding, evaluating and implementing effective risk management. 2017. 440 p. URL: <http://dspace.vnbrims.org:13000/jspui/bitstream/123456789/5077/1/Fundamentals%20of%20Risk%20Management.pdf>
4. Демченко Г. В. Ризик менеджмент [Електронний ресурс] : конспект лекцій для студентів спеціальності 073 «Менеджмент» першого бакалаврського рівня. Харків : ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2021. 74 с.

Тема 2. Класифікація ризиків

Теми для самостійної роботи

1. Зміст понять «ризик», «ризик-менеджмент» відповідно до ISO 31000:2009.
2. Визначальні положення загального оцінювання ризику, структури та процесу його керування.
3. Сукупність зовнішніх і внутрішніх факторів ризику, їх характерні риси.

Список рекомендованої літератури

1. Мороз В.М., Мороз С.А. Ризик-менеджмент : навч. посібник для студ. спец. 281 «Публічне управління та адміністрування». Харків : НТУ «ХП», 2018. 140 с.

2. Боровик М. В. Ризик-менеджмент : конспект лекцій для студентів магістратури усіх форм навчання спеціальності 073 – Менеджмент. Харків. нац. ун-т міськ. госп-ва ім. О. М. Бекетова. Харків : ХНУМГ ім. О. М. Бекетова, 2018. 65 с.
3. Семенова С.М. Класифікація ризиків: систематизований підхід з метою управління. *Вісник Хмельницького національного університету*. 2020. № 4. Т. 2. С. 42–51. URL: <http://journals.khnu.km.ua/vestnik/wp-content/uploads/2021/03/10.pdf>
4. Данченко О.Б., Занора В.О. Проектний менеджмент: управління ризиками та змінами в процесах прийняття управлінських рішень : монографія. Черкаси, 2019. 278 с.
5. On Risk Classification (2011). URL: https://www.actuary.org/sites/default/files/files/publications/RCWG_RiskMonograph_Nov2011.pdf
6. Керування ризиком. Методи загального оцінювання ризику (IEC/ISO 31010:2009, IDT). Київ, Мінекономрозвитку України, 2015. URL: <https://khoda.gov.ua/image/catalog/files/dstu%2031010.pdf>
7. ДСТУ ISO 31000:2018 Менеджмент ризиків. Принципи та настанови (ISO 31000:2018, IDT). URL: https://online.budstandart.com/ua/catalog/doc-page.html?id_doc=80322

Тема 3. Методичні підходи до ідентифікації, вимірювання та оцінки ризиків

Теми для самостійної роботи

1. Джерела інформації для ідентифікації ризиків.
2. Чек-лист ідентифікації ризиків.
3. Інструменти ідентифікації ризиків. Брейнсторм.
4. Попередній аналіз небезпек РНА (Preliminary Hazard Analysis) в ідентифікації ризиків.
5. Дослідження HAZOP (Hazard and Operability Study) в ідентифікації ризиків.

6. Аналіз небезпеки та критичних контрольних точок HACCP (Hazard Analysis and Critical Control Points) в ідентифікації ризиків.

7. Аналіз видів та критичності відмов FMEA (Failure Mode Effect Analysis) в ідентифікації ризиків.

8. Аналіз дерева несправностей в ідентифікації ризиків.

9. Панельні дискусії в оцінці ризиків.

Список рекомендованої літератури

1. Демченко Г. В. Ризик менеджмент [Електронний ресурс] : конспект лекцій для студентів спеціальності 073 «Менеджмент» першого бакалаврського рівня / Г. В. Демченко. Харків : ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2021. 74 с.

2. Олійник О.О. Ідентифікація ризиків як складова процесу управління ризиками в бізнесі. *Bulletin National University of Water and Environmental Engineering*. 2022. Vol.2 No. 98. DOI: <https://doi.org/10.31713/ve2202218>.

3. Про затвердження Порядку здійснення ризико-орієнтованого відбору об'єктів внутрішнього аудиту у системі Держгеокадастру для планування діяльності з внутрішнього аудиту: Наказ Державної служби України з питань геодезії, картографії та кадастру № 349 від 16.11.2022. URL: <https://land.gov.ua/wpcontent/uploads/2022/11/%D0%9D%D0%B0%D0%BA%D0%B0%D0%B7-349-%D0%B2%D1%96%D0%B4-16.11.2022.pdf>.

4. Про затвердження інструкції з організації внутрішнього контролю в районній державній адміністрації, на підприємствах, в установах та організаціях, що належать до сфери управління райдержадміністрації: Розпорядження Коломийської районної державної адміністрації Івано-Франківської області № 174 від 24.07.2019. https://kolrda.gov.ua/sites/kolrda.gov.ua/files/inline_files/aacb27df7ba255fc2c1a45954dd2a50d.pdf.

Тема 4. Невизначеність і прийняття рішень в ризик-менеджменті

Теми для самостійної роботи

1. Аналіз невизначеності як категорії економічної науки.

2. Ризик як міра невизначеності.

3. Невизначеність та ризик в діяльності сучасних підприємств.
4. Особливості феномену невизначеності на сучасному етапі.

Список рекомендованої літератури

1. Мороз В.М., Мороз С.А. Ризик-менеджмент : навч. посібник для студ. спец. 281 «Публічне управління та адміністрування». Харків : НТУ «ХП», 2018. 140 с.
2. Боровик М. В. Ризик-менеджмент : конспект лекцій для студентів магістратури усіх форм навчання спеціальності 073 «Менеджмент». Харків. нац. ун-т міськ. госп-ва ім. О. М. Бекетова. Харків : ХНУМГ ім. О. М. Бекетова, 2018. 65 с.
3. Horkin P. Fundamentals of Risk Management: Understanding, evaluating and implementing effective risk management. 2017. 440 p. URL: <http://dspace.vnbrims.org:13000/jspui/bitstream/123456789/5077/1/Fundamentals%20of%20Risk%20Management.pdf>
4. Момотюк Л. (2021). Розділ 11. Невизначеність та ризик у діяльності сучасних підприємств. URL: <https://ekmair.ukma.edu.ua/server/api/core/bitstreams/d726a15e-3c26-4420-85d6-0e1d94522f32/content>
5. Решетило В.П., Федотова Ю.В. Аналіз невизначеності як економічної категорії. *Економіка і суспільство*. 2016. Вип. 3. С. 13–16. URL: https://economyandsociety.in.ua/journals/3_ukr/3.pdf
6. Березька К.М. (2022) Моделювання економічних процесів в умовах ризику і невизначеності. URL: <http://dspace.tnpu.edu.ua/bitstream/123456789/26063/1/nemih.pdf>

Тема 5. Стратегічний ризик-менеджмент

Теми для самостійної роботи

1. Актуальність проблеми стратегічного ризик-менеджменту.
2. Значення стратегічного ризик-менеджменту в діяльності сучасних компаній .

3. Турбулентність зовнішнього середовища в стратегічному ризик-менеджменті.

Список рекомендованої літератури

1. Федулова І.В. Стратегія ризик-менеджменту. *Менеджмент та підприємництво в Україні*. 2019. URL: <https://science.lpnu.ua/sites/default/files/journalpaper/2019/dec/20453/management-65-74.pdf>

2. Черкас Д. М. PEST- і SWOT-аналіз діяльності промислових підприємств України (на прикладі машинобудування). *Вісник Одеського національного університету*. Серія : Економіка. 2017. Т. 22, Вип. 3. С. 103–106. URL: http://nbuv.gov.ua/UJRN/Vonu_econ_2017_22_3_22

3. Мороз В.М., Мороз С.А. Ризик-менеджмент : навч. посібник для студ. спец. 281 «Публічне управління та адміністрування». Харків : НТУ «ХП», 2018. 140 с.

4. Боровик М. В. Ризик-менеджмент : конспект лекцій для студентів магістратури усіх форм навчання спеціальності 073 «Менеджмент». Харків. нац. ун-т міськ. госп-ва ім. О. М. Бекетова. Харків : ХНУМГ ім. О. М. Бекетова, 2018. 65 с.

5. Гросул В.А. Жилиякова О.В. Турбулентність зовнішнього середовища: сутність, детермінанти протистояння під час формування антикризової стратегії підприємства. *Вісник Хмельницького національного університету*. 2015. № 2. Том 1. С. 22–29.

Тема 6. Операційний ризик-менеджмент

Теми для самостійної роботи

1. Положення про управління операційним ризиком акціонерного товариства «Банк «Український капітал»». URL: <https://ukrcapital.com.ua/en/informatsiya-dlya-aktsioneriv-ta-steykholderiv/informatsiya-shchodo-korporatyvnoho-upravlinnya/upravlinniaryzykamy/1854-polozhennia-pro-upravlinnia-operatsiinomy-ryzykamy/file.html>

2. Про затвердження Положення про порядок визначення банками України мінімального розміру операційного ризику: Постанова № 156 від 24.12.2024. URL: gov.ua/laws/show/v0156500-19#Text

Список рекомендованої літератури

1. Бортнікова Є.В. Історія походження та сутність понять «ризик», «ризик-менеджмент» та операційні ризики». *Ефективна економіка*. 2012. № 8. URL: <http://www.economy.nayka.com.ua/?op=1&z=1336>

2. Посохов І.М. Операційні ризики: управління та основні напрями зниження. *Вісник економіки транспорту і промисловості*. 2012. № 37. С. 229–233. URL: <https://repository.kpi.kharkov.ua/server/api/core/bitstreams/ccda5fd6-dc51-4d19-984f-37ff85354a49/content>

3. Положення про управління операційним ризиком акціонерного товариства «Банк «Український капітал»». URL: <https://ukrcapital.com.ua/en/informatsiya-dlya-aktsioneriv-ta-steykholderiv/informatsiya-shchodo-korporatyvnoho-upravlinnya/upravlinnia-ryzykamy/1854-polozhennia-pro-upravlinnia-operatsiinymy-ryzykamy/file.html>

4. Про затвердження Положення про організацію внутрішнього контролю в банках України та банківських групах: Правління Національного банку України № 88 від 2 липня 2019 р. URL: <https://ips.ligazakon.net/document/PB19121?an=1>

5. Положення про управління операційним ризиком акціонерного товариства «Банк «Український капітал»». URL: <https://ukrcapital.com.ua/en/informatsiya-dlya-aktsioneriv-ta-steykholderiv/informatsiya-shchodo-korporatyvnoho-upravlinnya/upravlinnia-ryzykamy/1854-polozhennia-pro-upravlinnia-operatsiinymy-ryzykamy/file.html>

6. Про затвердження Положення про порядок визначення банками України мінімального розміру операційного ризику: Постанова № 156 від 24.12.2024. URL: gov.ua/laws/show/v0156500-19#Text

Тема 7. Проектний ризик-менеджмент

Теми для самостійної роботи

1. Управління ризиками за фазами життєвого циклу проекту.
2. Шкала оцінки впливу ризику при реалізації проекту.
3. Принцип Парето в проектному ризик-менеджменті.
4. «Міграція» проектного ризику.

Список рекомендованої літератури

1. Гавриш О.А., Кузнецова К.О., Мельникова В.А. Ризик-менеджмент будівельних підприємств проектно-орієнтованого типу: монографія / Під редакцією Лисецької Н.М. К.: КПІ ім. Ігоря Сікорського, 2023. 211 с. URL: <https://ela.kpi.ua/server/api/core/bitstreams/23c3738a-c269-4378-87d0-069a07871bc7/content>
2. Чернега В.В., Клименко М.А. Сучасні підходи до ризик-менеджменту інвестиційних проектів. *Young Scientist*. 2022. № 11. URL: <https://ir.vtei.edu.ua/g.php?fname=28318.pdf>
3. Мороз В.М., Мороз С.А. Ризик-менеджмент : навч. посібник для студ. спец. 281 «Публічне управління та адміністрування». Харків : НТУ «ХП», 2018. 140 с.
4. Боровик М. В. Ризик-менеджмент : конспект лекцій для студентів магістратури усіх форм навчання спеціальності 073 «Менеджмент». Харків. нац. ун-т міськ. госп-ва ім. О. М. Бекетова. Харків : ХНУМГ ім. О. М. Бекетова, 2018. 65 с.

Тема 8. Фінансовий ризик-менеджмент

Теми для самостійної роботи

1. Класифікація ризиків у фінансовій сфері.
2. Практичні аспекти використання двовимірної карти ризиків у фінансовій сфері.
3. Використання методу аналогій при оцінці економічного ризику в фінансовій сфері.

4. Використання аналізу чутливості при оцінці економічного ризику в фінансовій сфері.
5. Моделі оцінювання ймовірності банкрутства.
6. Модель оцінювання капітальних активів (САРМ).
7. Однофакторна модель Шарпа.
8. Метод середньозваженої вартості капіталу.
9. Кредитні рейтинги та статистика дефолтів.
10. Узагальнена рейтингова шкала провідних міжнародних агентств.

Список рекомендованої літератури

1. Долинський Л. Фінансовий ризик-менеджмент: навч.-метод. посібник. Київ, Національний університет «Києво-Могилянська академія». НаУКМА, 2022. 132 с.
2. Самура Ю.О. Ризик-менеджмент у системі забезпечення фінансово-економічної безпеки підприємств, установ та організацій. *Мукачівський державний університет*. 2018. № 11. С. 732–738. URL: https://economyandsociety.in.ua/journals/15_ukr/110.pdf
3. Згурська О.М. Диверсифікація як метод підвищення економічної ефективності підприємства. *Інвестиції: практика та досвід*. 2018. № 13. С. 16–21. URL: http://www.investplan.com.ua/pdf/13_2018/5.pdf
4. Васьківська К. В., Сич О. А. Фінансовий менеджмент : навч. посіб. Львів : «ГАЛИЧ-ПРЕС», 2017. 236 с.
5. Зайцева І.Ю. Фінансовий менеджмент: навч. посібник. Харків: УкрДУЗТ, 2018. 250 с.
6. Жигалкевич Ж.М., Кам'янська О.В. Фінансовий менеджмент: навч. посіб. для здобувачів другого (магістерського) рівня вищої освіти спеціальності 073 «Менеджмент». Київ : КПП ім. Ігоря Сікорського, 2022. 214 с.

Тема 9. Екологічний ризик-менеджмент

Теми для самостійної роботи

1. Співвідношення понять небезпека, загроза, ризик.

2. Структура екологічної небезпека.
 3. Техноекосистеми та техногенні ризики.
 4. Система екологічного управління (відповідно до ДСТУ ISO 14001:2015. Системи екологічного управління. Вимоги та настанови щодо застосування).
 5. Підходи до оцінювання джерел небезпеки та ризику.
 6. Модель оцінювання ризику з використанням розподілу Вейбулла-Гніденко.
1. Оцінювання техногенного і екологічного ризику на основі екологічно-економічних показників ефективності виробництва.
 2. Оцінювання екологічного ризику на основі показників якості, індикаторів та індексів.

Список рекомендованої літератури

1. Бредун В.І. Екологічна безпека та управління ризиками: навч. посібник. Полтава: Видання нац. ун-ту імені Юрія Кондратюка, 2021. 189 с.
2. ДСТУ ISO 14001:2015. Системи екологічного управління. Вимоги та настанови щодо застосування. URL: <https://zakon.isu.net.ua/sites/default/files/normdocs/dstu.pdf>
3. Войціцький В.М., Хижняк С.В., Данчук В.В., Мідик СВ., Грищук І.А., Ушкальов В.О. Екологічні ризики: природа і критерії. *Екологічні науки*. 2020. № 4 (31). DOI <https://doi.org/10.32846/2306-9716/2020.eco.4-31.21>
4. Добровольський В.В. Екологічний ризик: оцінка і управління: навч. посіб. Миколаїв: Вид-во ЧДУ ім. П. Могили, 2010. 216 с.
5. Аналіз ризику – методологічна основа для розв’язання проблем безпеки людини й довкілля: метод. вказівки до вивчення дисципліни «Соціально-економічні проблеми управління станом довкілля». Київ «Політехніка», 2018. URL: <https://apeps.kpi.ua/downloads/%D1%80%D0%B8%D0%B7%D0%B8%D0%BA%D0%B8%201.pdf>

Тема 10. Культура ризику

Теми для самостійної роботи

1. Ризик-культура як підґрунтя вдосконалення системи управління ризиками та забезпечення фінансової стабільності підприємства.
2. Підходи до оцінки якості ризик-культури організації.
3. Актуальність розвитку ризик-культури в Україні.
4. Напрямки розвитку ризик-культури в підприємствах України.

Список рекомендованої літератури

1. Вовченко О.С. Формування ризик-культури банку як умова його фінансової стабільності. *Фінансовий простір*. 2020. № 4 (40). С. 143–151. DOI: [https://doi.org/10.18371/fp.4\(40\).2020.221719](https://doi.org/10.18371/fp.4(40).2020.221719)
2. Bianchi N., Fiordelisi F. Measuring and Assessing Risk Culture. *Risk Culture in Banking*. Palgrave Macmillan, 2017. P. 155–176.
3. Cultivating an Intelligent Risk Culture: A Fresh Perspective. Deloitte Australia. Sydney, AU: Deloitte Touche Tohmatsu Ltd, 2012. 12 p.
4. Horkin P. Fundamentals of Risk Management: Understanding, evaluating and implementing effective risk management. 2017. 440 p. URL: <http://dspace.vnbrims.org:13000/jspui/bitstream/123456789/5077/1/Fundamentals%20of%20Risk%20Management.pdf>

Тема 11. Управління ризиками

Теми для самостійної роботи

1. Процес управління ризиками.
2. Вертикаль управління ризиками на підприємстві.
3. Практичні аспекти зниження ризику в процесі господарської діяльності підприємства.
4. Шляхи зниження ризиків підприємницької діяльності.

Список рекомендованої літератури

1. Мороз В.М., Мороз С.А. Ризик-менеджмент : навч. посібник для студ. спец. 281 «Публічне управління та адміністрування». Харків : НТУ «ХП», 2018. 140 с.

2. Боровик М. В. Ризик-менеджмент : конспект лекцій для студентів магістратури усіх форм навчання спеціальності 073 «Менеджмент». Харків. нац. ун-т міськ. госп-ва ім. О. М. Бекетова. Харків : ХНУМГ ім. О. М. Бекетова, 2018. 65 с.

3. Horkin P. Fundamentals of Risk Management: Understanding, evaluating and implementing effective risk management. 2017. 440 p. URL: <http://dspace.vnbrims.org:13000/jspui/bitstream/123456789/5077/1/Fundamentals%20of%20Risk%20Management.pdf>

Тема 12. Звітність по управлінню ризиками

Теми для самостійної роботи

1. Sarbanes-Oxley Act of 2002.
2. Звітність з ризику в Благодійних організаціях.

Список рекомендованої літератури

1. Демченко Г. В. Ризик менеджмент [Електронний ресурс] : конспект лекцій для студентів спеціальності 073 "Менеджмент" першого бакалаврського рівня. Харків : ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2021. 74 с.

2. Звіт Комітету наглядової ради АТ «А-Банк» з управління ризиками за 2022 рік. URL: https://a-bank.com.ua/static/committe_manage_risks_2022.pdf

3. «Про національну безпеку України» : Закон України. URL: <https://ips.ligazakon.net/document/JH6841AA>

4. Звіт про проведення національної оцінки ризиків у сфері запобігання та протидії легалізації (відмиванню) доходів, одержаних злочинним шляхом, та фінансуванню тероризму. URL: https://finmonitoring.in.ua/wp-content/uploads/2017/02/zvit_nor.pdf

5. Про затвердження Порядку здійснення аналізу та оцінки ризиків, розроблення і реалізації заходів з управління ризиками для визначення форм та обсягів митного контролю: Наказ Міністерства Фінансів України № 684 від 31.07.2015. (із змінами і доповненнями) URL: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/z1021-15#Text>

3.2. Теми для виступів студентів з доповідями

1. Актуальність формування і розвитку ризик-менеджменту в сучасних компаніях.
2. Ризик як економічна категорія.
3. Брейнсторм як підхід до ідентифікації ризиків в компанії.
4. Поняття «ризик» і «невизначеність»: загальне і відмінне.
5. Проблеми стратегічного ризик-менеджменту в сучасних умовах діяльності компаній.
6. Невизначеність в проекті.
7. Економічний ризик у фінансовій сфері.
8. Співвідношення понять небезпека, загроза, ризик.
9. Чому є важливим впровадження культури управління ризиками?
10. Елементи системи управління ризиками в компанії.

3.3. Проблемні питання і завдання

1. Позитивні і від'ємні фактори роботи відділу з ризик-менеджменту у малих, середніх, великих компаніях.
2. Міра ризику в компаніях різних сфер діяльності.
3. Багатокритеріальний аналіз в ризик-менеджменті.
4. Поєднання системного, ситуаційного та ресурсного підходів у прийнятті рішень в ризик-менеджменті.
5. Необхідність стратегічного ризик-менеджменту.
6. Урахування ризику в операційній діяльності компанії: проблемні питання.
7. Методи аналізу ризиків в реалізації проектів: який краще?
8. Практичні аспекти двовимірної карти ризиків у фінансовій сфері.
9. Підходи до визначення ризику як міри можливої шкоди від негативних наслідків.

10. Критерії оцінки культури ризику в компанії.
11. Критерії оцінки роботи ризик-менеджера.

3.4. Теми для дискусій

1. Необхідність формування і розвитку служби ризик-менеджменту в компаніях, які є різними за розмірами.
2. Шкала ризику: чи повинна вона бути однією для компаній різних сфер діяльності?
3. Співвідношення кількісних і якісних методів дослідження ризиків.
4. Критерій Лапласа-Бернуллі, критерій Вальда, критерій Севіджа, максимінний критерій. Якій критерій краще до використання в ризик-менеджменті?
5. Стратегічний ризик-менеджмент: хто, як розробляє і реалізує.
6. Положення про управління операційним ризиком в компанії: необхідність прийняття і реалізації.
7. Робота ризик-менеджера на різних етапах життєвого циклу проекту.
8. Критерії до обрання підходів кількісного оцінювання фінансових ризиків в компанії.
9. Критерії та ознаки екологічної безпеки.
10. Підходи до формування ризик-культури в підприємствах України.
11. Організаційно-функціональна структура ризик-менеджменту на підприємстві.

СПИСОК РЕКОМЕНДОВАНОЇ ЛІТЕРАТУРИ

1. Bianchi N., Fiordelisi F. Measuring and Assessing Risk Culture. Risk Culture in Banking. Palgrave Macmillan, 2017. P. 155–176.
2. Cultivating an Intelligent Risk Culture: A Fresh Perspective. Deloitte Australia. Sydney, AU: Deloitte Touche Tohmatsu Ltd, 2012. 12 p.

3. Horkin P. Fundamentals of Risk Management: Understanding, evaluating and implementing effective risk management. 2017. 440 p. URL: <http://dspace.vnbrims.org:13000/jspui/bitstream/123456789/5077/1/Fundamentals%20of%20Risk%20Management.pdf>
4. On Risk Classification (2011). URL: https://www.actuary.org/sites/default/files/files/publications/RCWG_RiskMonograph_Nov2011.pdf
5. Аналіз ризику – методологічна основа для розв’язання проблем безпеки людини й довкілля: метод. вказівки до вивчення дисципліни «Соціально-економічні проблеми управління станом довкілля». Київ «Політехніка», 2018. URL: <https://apeps.kpi.ua/downloads/%D1%80%D0%B8%D0%B7%D0%B8%D0%BA%D0%B8%201.pdf>
6. Березька К.М. (2022) Моделювання економічних процесів в умовах ризику і невизначеності. URL: <http://dspace.tnpu.edu.ua/bitstream/123456789/26063/1/nemih.pdf>
7. Боровик М. В. Ризик-менеджмент : конспект лекцій для студентів магістратури усіх форм навчання спеціальності 073 «Менеджмент». Харків. нац. ун-т міськ. госп-ва ім. О. М. Бекетова. Харків : ХНУМГ ім. О. М. Бекетова, 2018. 65 с.
8. Бортнікова Є.В. Історія походження та сутність понять «ризик», «ризик-менеджмент» та операційні ризики». *Ефективна економіка*. 2012. № 8. URL: <http://www.economy.nayka.com.ua/?op=1&z=1336>
9. Бредун В.І. Екологічна безпека та управління ризиками: навч. посібник. Полтава: Видання Національного університету імені Юрія Кондратюка, 2021. 189 с.
10. Васьківська К. В., Сич О. А. Фінансовий менеджмент : навч. посіб. Львів : «ГАЛИЧ-ПРЕС», 2017. 236 с.
11. Вовченко О.С. Формування ризик-культури банку як умова його фінансової стабільності. *Фінансовий простір*. 2020. № 4(40). С. 143–151. DOI: [https://doi.org/10.18371/fp.4\(40\).2020.221719](https://doi.org/10.18371/fp.4(40).2020.221719)

12. Войціцький В.М., Хижняк С.В., Данчук В.В., Мідик С.В., Грищук І.А., Ушкальов В.О. Екологічні ризики: природа і критерії. *Екологічні науки*. 2020. № 4 (31). DOI <https://doi.org/10.32846/2306-9716/2020.eco.4-31.21>
13. Гавриш О.А., Кузнецова К.О., Мельникова В.А. Ризик-менеджмент будівельних підприємств проектно-орієнтованого типу: монографія / Під редакцією Лисецької Н.М. К.: КПП ім. Ігоря Сікорського, 2023. 211 с. URL: <https://ela.kpi.ua/server/api/core/bitstreams/23c3738a-c269-4378-87d0-069a07871bc7/content>
14. Данченко О.Б., Занора В.О. Проектний менеджмент: управління ризиками та змінами в процесах прийняття управлінських рішень : монографія. Черкаси, 2019. 278 с.
15. Демченко Г. В. Ризик менеджмент [Електронний ресурс] : конспект лекцій для студентів спеціальності 073 «Менеджмент» першого бакалаврського рівня. Харків : ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2021. 74 с.
16. Добровольський В.В. Екологічний ризик: оцінка і управління: навч. посіб. Миколаїв: Вид-во ЧДУ ім. П. Могили, 2010. 216 с.
17. Долинський Л. Фінансовий ризик-менеджмент: навч.-метод. посібник. Київ, Національний університет «Києво-Могилянська академія». НаУКМА, 2022. 132 с.
18. Дорошенко О.Г., Буряк Ю.А. Побудова матриці ризиків для банківської системи України. *Гроші, фінанси і кредит*. 2020. Вип. 47. С. 161–167. DOI: <https://doi.org/10.32843/infrastructure47-30>
19. ДСТУ ISO 14001:2015. Системи екологічного управління. Вимоги та настанови щодо застосування. URL: <https://zakon.isu.net.ua/sites/default/files/normdocs/dstu.pdf>
20. Жигалкевич Ж.М., Кам'янська О.В. Фінансовий менеджмент: навч. посіб. для здобувачів другого (магістерського) рівня вищої освіти спеціальності 073 «Менеджмент». Київ : КПП ім. Ігоря Сікорського, 2022. 214 с.
21. Зайцева І.Ю. Фінансовий менеджмент: навч. посібник. Харків: УкрДУЗТ, 2018. 250 с.

22. Звіт Комітету наглядової ради АТ «А-Банк» з управління ризиками за 2022 рік. URL: https://a-bank.com.ua/static/committe_manage_risks_2022.pdf
23. Звіт про проведення національної оцінки ризиків у сфері запобігання та протидії легалізації (відмиванню) доходів, одержаних злочинним шляхом, та фінансуванню тероризму. URL: https://finmonitoring.in.ua/wp-content/uploads/2017/02/zvit_nor.pdf
24. Згурська О.М. Диверсифікація як метод підвищення економічної ефективності підприємства. Інвестиції: практика та досвід. 2018. № 13. С. 16–21. URL: http://www.investplan.com.ua/pdf/13_2018/5.pdf
25. Момотюк Л. (2021). Розділ 11. Невизначеність та ризик у діяльності сучасних підприємств. URL: <https://ekmair.ukma.edu.ua/server/api/core/bitstreams/d726a15e-3c26-4420-85d6-0e1d94522f32/content>
26. Мороз В.М., Мороз С.А. Ризик-менеджмент : навч. посібник для студ. спец. 281 «Публічне управління та адміністрування». Харків : НТУ «ХП», 2018. 140 с.
27. Положення про управління операційним ризиком акціонерного товариства «Банк «Український капітал»». URL: <https://ukrcapital.com.ua/en/informatsiya-dlya-aktsioneriv-ta-steykholderiv/informatsiya-shchodo-korporatyvnoho-upravlinnya/upravlinnia-ryzykamy/1854-polozhennia-pro-upravlinnia-operatsiinymy-ryzykamy/file.html>
28. Положення про управління операційним ризиком акціонерного товариства «Банк «Український капітал»». URL: <https://ukrcapital.com.ua/en/informatsiya-dlya-aktsioneriv-ta-steykholderiv/informatsiya-shchodo-korporatyvnoho-upravlinnya/upravlinnia-ryzykamy/1854-polozhennia-pro-upravlinnia-operatsiinymy-ryzykamy/file.html>
29. Посохов І.М. Операційні ризики: управління та основні напрями зниження. Вісник економіки транспорту і промисловості. 2012. № 37. С. 229–233. URL: <https://repository.kpi.kharkov.ua/server/api/core/bitstreams/ccda5fd6-dc51-4d19-984f-37ff85354a49/content>

30. Про затвердження Положення про організацію внутрішнього контролю в банках України та банківських групах: Правління Національного банку України № 88 від 2 липня 2019 р. URL: <https://ips.ligazakon.net/document/PB19121?an=1>

31. Про затвердження Положення про порядок визначення банками України мінімального розміру операційного ризику: Постанова № 156 від 24.12.2024. URL: gov.ua/laws/show/v0156500-19#Text

32. Про затвердження Порядку здійснення аналізу та оцінки ризиків, розроблення і реалізації заходів з управління ризиками для визначення форм та обсягів митного контролю: Наказ Міністерства Фінансів України № 684 від 31.07.2015. (із змінами і доповненнями) URL: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/z1021-15#Text>

33. Про національну безпеку України : Закон України. URL: <https://ips.ligazakon.net/document/JH6841AA>

34. Решетило В.П., Федотова Ю.В. Аналіз невизначеності як економічної категорії. *Економіка і суспільство*. 2016. Вип. 3. С. 13–16. URL: https://economyandsociety.in.ua/journals/3_ukr/3.pdf

35. Рудич О.О. Теоретико-методичні підходи до оцінки ризиків сільськогосподарського підприємства. *Агросвіт*. 2017. № 23. С. 39–44. URL: http://www.agrosvit.info/pdf/23_2017/7.pdf

36. Самура Ю.О. Ризик-менеджмент у системі забезпечення фінансово-економічної безпеки підприємств, установ та організацій. Мукачівський державний університет. 2018. № 11. С. 732–738. URL: https://economyandsociety.in.ua/journals/15_ukr/110.pdf

37. Семенова С.М. Класифікація ризиків: систематизований підхід з метою управління. *Вісник Хмельницького національного університету*. 2020. № 4. Т. 2. С. 42–51. URL: <http://journals.khnu.km.ua/vestnik/wp-content/uploads/2021/03/10.pdf>

38. Тарасова К.І. Методологічні засади кількісної оцінки ризиків. *Наукові записки Національного університету «Острозька академія». Серія «Економіка»*. 2013. С. 367–372. URL: <https://ecj.oa.edu.ua/articles/2013/n23/73.pdf>

39. Федулова І.В. Стратегія ризик-менеджменту. *Менеджмент та підприємництво в Україні*. 2019. URL: <https://science.lpnu.ua/sites/default/files/journalpaper/2019/dec/20453/management-65-74.pdf>
40. Васьківська К. В., Сич О. А. Фінансовий менеджмент : навч. посіб. Львів : «ГАЛИЧ-ПРЕС», 2017. 236 с.
41. Черкас Д. М. PEST- і SWOT-аналіз діяльності промислових підприємств України (на прикладі машинобудування). *Вісник Одеського національного університету. Серія : Економіка*. 2017. Т. 22, Вип. 3. С. 103–106. URL: http://nbuv.gov.ua/UJRN/Vonu_econ_2017_22_3_22
42. Чернега В.В., Клименко М.А. Сучасні підходи до ризик-менеджменту інвестиційних проєктів. *Young Scientist*. 2022. № 11. URL: <https://ir.vtei.edu.ua/g.php?fname=28318.pdf>

ЗМІСТ

| | стор. |
|--|-------|
| Вступ | 3 |
| 1. Форми самостійної роботи студентів | 3 |
| 2. Організація і контроль самостійної роботи студентів | 3 |
| 3. Завдання для самостійного виконання студентами | 4 |
| 3.1. Теми рефератів (за темами дисципліни) | 4 |
| 3.2. Теми для виступів студентів з доповідями | 16 |
| 3.3. Проблемні питання і завдання | 16 |
| 3.4. Теми для дискусій | 17 |
| Список рекомендованої літератури | 17 |

Навчальне видання

Методичні вказівки
до самостійної роботи
з навчальної дисципліни
«Ризик-менеджмент»

для студентів галузі знань 07 «Управління та адміністрування» спеціальності 073
«Менеджмент»
освітньо-кваліфікаційного рівня магістр
усіх форм навчання

Укладач:
ШИЯН Наталія Іванівна

Відповідальний за випуск (завідувач кафедри) О. ПРОХОРЕНКО
Роботу рекомендував до друку (експерт РВР) О. ЛІНЬКОВА
Комп'ютерна верстка Н. ШИЯН
В авторській редакції

План 2024 р. поз. 700

Підп. до друку . Формат 60x84/16. Гарнітура Таймс.
Друк офсетний. Обсяг 1 ум. друк. арк., 1,1 обл.-вид. арк.

Видавничий центр НТУ «ХПІ». 61002, Харків, вул. Фрунзе, 21
Свідоцтво про державну реєстрацію ДК №5478 від 21.08.2017 р.

Електронна версія