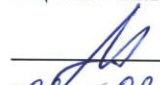


МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ  
 Чорноморський національний університет імені Петра Могили  
 Факультет економічних наук  
 Кафедра економіки та підприємництва

**“ЗАТВЕРДЖУЮ”**

Перший проректор

Іщенко Н.М.







  
 \_\_\_\_\_  
 “28” 08 2020 року

**РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ  
 «УПРАВЛІННЯ ПРОЄКТНИМИ РИЗИКАМИ»**

Спеціальність 076 «Підприємництво, торгівля та біржова діяльність»

Освітня програма «Економіка та управління підприємством»

Рівень вищої освіти – другий (магістерський)

Розробник	Кузьменко О.Б.	
Завідувач кафедри економіки та підприємництва	Кузьменко О.Б.	
Гарант освітньої програми	Кузьменко О.Б.	
В.о. декана факультету економічних наук	Філімонова О.Б.	
Директор ННЦ ІПДО	Норд Г.Л.	
Начальник НМВ	Шкірчак С.І.	

Миколаїв – 2020 рік

## 1. Опис навчальної дисципліни

Найменування показника	Характеристика дисципліни	
Найменування дисципліни	Управління проектними ризиками	
Галузь знань	07 Управління та адміністрування	
Спеціальність	076 Підприємництво, торгівля та біржова діяльність	
Спеціалізація (якщо є)	-	
Освітня програма	Економіка та управління підприємством	
Рівень вищої освіти	Другий (магістерський)	
Статус дисципліни	Вибіркова	
Курс навчання	5	
Навчальний рік	2020-2021	
Номер(и) семестрів (триместрів):	Денна форма	Заочна форма
	10	15, 16
Загальна кількість кредитів ЄКТС/годин	5 кредитів / 150 годин	
Структура курсу: – лекції – практичні заняття – годин самостійної роботи студентів	Денна форма	Заочна форма
	18	8
	36	8
	96	134
Відсоток аудиторного навантаження	36%	11%
Мова викладання	Українська	
Форма проміжного контролю (якщо є)	-	
Форма підсумкового контролю	Іспит	

## 2. Мета, завдання та результати вивчення дисципліни

**Метою дисципліни** «Управління проектними ризиками» є набуття студентами теоретичних знань щодо проектних ризиків та отримання практичних навичок реалізації заходів щодо їх зниження. Вивчення дисципліни передбачає формування теоретичних знань та практичних навичок у системі оцінки ступеня проектного ризику та вибору оптимальних інструментів для його зниження до мінімально можливого рівня.

**Завдання дисципліни:**

- вивченні теоретичних основ проектних ризиків;
- оволодіння методиками обробки інформації для оцінки ступеня проектного ризику;
- оволодінні навиками об'єктивного розуміння результатів управління проектними ризиками;
- формування критичного мислення при аналізі взаємозв'язків явищ і процесів різних рівнів діяльності виробничих підприємств і функціонування виробничої системи, прогнозування їх розвитку.

**Передумови вивчення дисципліни:** Управління товарним асортиментом.

**Очікувані результати навчання:**

В результаті вивчення дисципліни студент

*має знати:*

- теоретичні основи проектних ризиків (сутність, види, класифікацію);
- інструменти, які дозволяють знизити ступінь проектного ризику;
- особливості застосування інструментів хеджування ризику при впровадженні різних проектів.

*має вміти:*

- обирати найбільш ефективні інструменти хеджування проектних ризиків;
- оцінювати проектні ризики для прийняття рішень щодо реалізації заходів по управлінню ними;
- розробляти стратегію поведінки підприємця, що зменшує ступінь ризику;
- страхувати активи, перерозподіляти капіталовкладення між активами, управляти запасами для зниження проектного ризику.

### **Програмні компетенції:**

*загальні компетентності:*

ЗК1. Здатність до адаптації та дії в новій ситуації.

ЗК 2. Вміння виявляти, ставити та вирішувати проблеми.

ЗК4. Здатність спілкуватися з представниками інших професійних груп різного рівня (з експертами з інших галузей знань/видів економічної діяльності).

*спеціальні (фахові, предметні) компетентності*

СК2. Здатність проводити оцінювання продукції, товарів і послуг в підприємницькій, торговельній та/або біржовій діяльності.

СК 3. Здатність до ефективного управління діяльністю суб'єктів господарювання в сфері підприємництва, торгівлі та/або біржової діяльності.

СК4. Здатність до вирішення проблемних питань і прийняття управлінських рішень у професійній діяльності.

СК5. Здатність до ініціювання та реалізації інноваційних проектів в підприємницькій, торговельній та/або біржовій діяльності.

СК6. Здатність до вирішення проблемних завдань і прийняття рішень у сфері управління фінансово-економічними результатами і ризиками діяльності підприємства

### **Програмні результати навчання:**

РН1. Вміти адаптуватися та проявляти ініціативу і самостійність в ситуаціях, які виникають в професійній діяльності.

РН 2. Визначати, аналізувати проблеми підприємництва, торгівлі і біржової діяльності та розробляти заходи щодо їх вирішення.

РН4. Застосовувати бізнес-комунікації для підтримки взаємодії з представниками різних професійних груп.

РН7. Оцінювати продукцію, товари, послуги, а також процеси, що відбуваються в підприємницьких, торговельних та/або біржових структурах, і робити відповідні висновки для прийняття управлінських рішень.

РН 8. Розробляти і приймати рішення, спрямовані на забезпечення ефективності діяльності суб'єктів господарювання у сфері підприємницької, торговельної та/або біржової діяльності.

PH9. Вміти вирішувати проблемні питання, що виникають в діяльності підприємницьких, торговельних та/або біржових структур за умов невизначеності та ризиків.

PH10. Впроваджувати інноваційні проекти з метою створення умов для ефективного функціонування та розвитку підприємницьких, торговельних та/або біржових структур.

PH11. Вміти розробляти і впроваджувати проекти для виконання управлінських рішень щодо фінансово-економічних результатів і ризиків діяльності підприємства.

### 3. Програма навчальної дисципліни

Денна форма:

	Теми	Лекції	Практичні	Самостійна робота
1	Тема 1. Проектні ризики – сутність, види, класифікація	2	4	10
2	Тема 2. Аналіз і оцінка проектного ризику	2	4	12
3	Тема 3. Управління проектними ризиками	2	4	10
4	Тема 4. Транспортні ризики та їх хеджування	2	4	10
5	Тема 5. Ризик проектів реального інвестування.	2	4	10
6	Тема 6. Ризик проектів фінансового інвестування. Основи теорії портфеля.	2	4	10
7	Тема 7. Страхування проектних ризиків	2	4	12
8	Тема 8. Диверсифікація як спосіб зниження проектного ризику	2	4	10
9	Тема 9. Управління запасами як спосіб зниження проектного ризику	2	4	12
	Всього за курсом	<b>18</b>	<b>36</b>	<b>96</b>

Заочна форма:

	Теми	Лекції	Практичні	Самостійна робота
1	Тема 1. Проектні ризики – сутність, види, класифікація	1	1	14
2	Тема 2. Аналіз і оцінка проектного ризику	1	1	14
3	Тема 3. Управління проектними ризиками	1	1	16
4	Тема 4. Транспортні ризики та їх хеджування	1	1	17
5	Тема 5. Ризик проектів	1	1	14

	реального інвестування.			
6	Тема 6. Ризик проектів фінансового інвестування. Основи теорії портфеля.	1	1	16
7	Тема 7. Страхування проектних ризиків	1	1	14
8	Тема 8. Диверсифікація як спосіб зниження проектного ризику	0,5	0,5	14,5
9	Тема 9. Управління запасами як спосіб зниження проектного ризику	0,5	0,5	14,5
	Всього за курсом	<b>8</b>	<b>8</b>	<b>134</b>

#### 4. Зміст навчальної дисципліни Денна форма

##### 4.1. План лекцій

№	Тема заняття / план
1	<b>Тема 1. Проектні ризики – сутність, види, класифікація</b> 1) Актуальність вивчення, сутність проектних ризиків. Причини їх виникнення. 2) Основні види та класифікація проектних ризиків. 3) Особливості різних видів проектних ризиків.
2	<b>Тема 2. Аналіз і оцінка проектного ризику</b> 1) Якісний аналіз проектного ризику. 2) Кількісний аналіз проектного ризику. 3) Система кількісних оцінок ступеня проектного ризику.
3	<b>Тема 3. Управління проектними ризиками</b> 1) Основні принципи управління проектним ризиком. 2) Блок-схема процесу управління проектним ризиком. 3) Зовнішні і внутрішні способи зниження проектного ризику.
4	<b>Тема 4. Транспортні ризики та їх хеджування</b> 1) Класифікація транспортних ризиків за Міжнародною торгівельною палатою. 2) Перерозподіл транспортного ризику між продавцем і покупцем товару.
5	<b>Тема 5. Ризик проектів реального інвестування.</b> 1) Принципи та показники оцінки ризиків інвестиційних проектів. 2) Методи оцінки ризиків інвестиційних проектів.
6	<b>Тема 6. Ризик проектів фінансового інвестування. Основи теорії портфеля.</b> 1) Фінансове інвестування – сутність, мета і завдання. 2) Ризик портфеля цінних паперів. 3) Управління портфелем цінних паперів з різною кількістю їх видів для оптимізації рівня ризику.
7	<b>Тема 7. Страхування проектних ризиків</b> 1) Страхові випадки проектних ризиків.. 2) Механізм відшкодування збитків при страхуванні проектних ризиків.
8	<b>Тема 8. Диверсифікація як спосіб зниження проектного ризику</b> 1) Диверсифікація реальних і фінансових інвестиційних проектів – сутність, види і правила. 2) Кореляція між нормами прибутку цінних паперів та її застосування.
9	<b>Тема 9. Управління запасами як спосіб зниження проектного ризику</b> 1) Обсяг резерву для безперебійного забезпечення проекту.

2) Резервування грошових засобів для покриття випадкових затрат.
3) Модель М.Міллера і Д.Орра.
4) Модель формування оптимального резерву.

## 4.2. План практичних занять

№	Тема заняття / план
1	<b>Тема 1. Проектні ризики – сутність, види, класифікація</b> 1) Розглянути актуальність вивчення, сутність проектних ризиків. Причини їх виникнення. 2) Розглянути основні види та класифікацію проектних ризиків.
2	<b>Тема 1. Проектні ризики – сутність, види, класифікація</b> 1) Проаналізувати особливості різних видів проектних ризиків. 2) Провести тестове опитування по темі.
3	<b>Тема 2. Аналіз і оцінка проектного ризику</b> 1) Зробити якісний аналіз проектного ризику при різних видах проектів. 2) Провести тестове опитування по темі.
4	<b>Тема 2. Аналіз і оцінка проектного ризику</b> 1) Розглянути систему кількісних оцінок ступеня проектного ризику. 2) Розв'язування задач на кількісний аналіз проектного ризику.
5	<b>Тема 3. Управління проектними ризиками</b> 1) Розглянути основні принципи управління проектним ризиком. 2) Проаналізувати блок-схему процесу управління проектним ризиком.
6	<b>Тема 3. Управління проектними ризиками</b> 1) Розглянути застосування зовнішніх способів зниження проектного ризику. 2) Розглянути застосування внутрішніх способів зниження проектного ризику.
7	<b>Тема 4. Транспортні ризики та їх хеджування</b> 1) Розглянути класифікацію транспортних ризиків за Міжнародною торгівельною палатою та ІНКОТЕРМС. 2) Провести тестове опитування по темі.
8	<b>Тема 4. Транспортні ризики та їх хеджування</b> 1) Аналіз конкретних ситуацій перерозподілу транспортного ризику між продавцем і покупцем продукції для проекту. 2) Провести тестове опитування по темі.
9	<b>Тема 5. Ризик проектів реального інвестування</b> 1) Розглянути принципи та показники оцінки ризиків інвестиційних проектів. 2) Розв'язування задач на визначення показників оцінки ризиків інвестиційних проектів.
10	<b>Тема 5. Ризик проектів реального інвестування.</b> 1) Розглянути методи оцінки ризиків інвестиційних проектів. 2) Розв'язування задач на застосування різних методи оцінки ризиків інвестиційних проектів.
11	<b>Тема 6. Ризик проектів фінансового інвестування. Основи теорії портфеля.</b> 1) Розглянути фінансове інвестування: сутність, мету і завдання. 2) Основні показники оцінки ризику цінних паперів. 3) Розв'язування задач на визначення показників оцінки ризику цінних паперів.
12	<b>Тема 6. Ризик проектів фінансового інвестування. Основи теорії портфеля.</b> 1) Розглянути теорію управління портфелем цінних паперів. 2) Розв'язування задач на визначення структури портфеля цінних паперів з різною кількістю їх видів для оптимізації рівня ризику.
13	<b>Тема 7. Страхування проектних ризиків</b>

	1) Розглянути страхові випадки проектних ризиків. 2) Провести тестове опитування по темі.
14	<b>Тема 7. Страхування проектних ризиків</b> 1) Проаналізувати механізм відшкодування збитків при страхуванні проектних ризиків. 2) Розв'язування задач на визначення розміру відшкодування збитків при страхуванні проектних ризиків.
15	<b>Тема 8. Диверсифікація як спосіб зниження проектного ризику</b> 1) Розглянути диверсифікацію в проектній діяльності – сутність, види і правила. 2) Провести тестове опитування по темі.
16	<b>Тема 8. Диверсифікація як спосіб зниження проектного ризику</b> 1) Розглянути кореляцію між нормами прибутку цінних паперів. 2) Розв'язування задач на визначення кореляції та оптимальної структури портфеля цінних паперів.
17	<b>Тема 9. Управління запасами як спосіб зниження проектного ризику</b> 1) Розв'язування задач по визначенню обсягу резерву продукції для безперебійного забезпечення проектів. 2) Розв'язування задач по визначенню резерву грошових засобів для покриття випадкових затрат.
18	<b>Тема 9. Управління запасами як спосіб зниження проектного ризику</b> 1) Розв'язування задач за допомогою моделі М.Міллера і Д.Орра. 2) Розв'язування задач за допомогою моделі формування оптимального резерву.

### Заочна форма

#### 4.3. План лекцій

№	Тема заняття / план
1	<b>Тема 1, 2 Проектні ризики – сутність, види, класифікація, аналіз та оцінка</b> 1) Актуальність вивчення, сутність проектних ризиків. Причини їх виникнення. 2) Основні види та класифікація проектних ризиків. 3) Якісний і кількісний аналіз проектного ризику. 4) Система кількісних оцінок ступеня проектного ризику.
2	<b>Тема 3, 4 Управління проектними ризиками. Транспортні ризики та їх хеджування</b> 1) Основні принципи управління проектним ризиком. 2) Блок-схема процесу управління проектним ризиком. 3) Зовнішні і внутрішні способи зниження проектного ризику. 4) Класифікація транспортних ризиків за Міжнародною торгівельною палатою та перерозподіл транспортного ризику згідно неї.
3	<b>Тема 5, 6 Ризик проектів реального інвестування. Ризик проектів фінансового інвестування. Основи теорії портфеля.</b> 1) Принципи та показники оцінки ризиків інвестиційних проектів. 2) Методи оцінки ризиків інвестиційних проектів. 3) Фінансове інвестування – сутність, мета і завдання. 4) Ризик портфеля цінних паперів. 5) Управління портфелем цінних паперів з різною кількістю їх видів для оптимізації рівня ризику.
4	<b>Тема 7, 8, 9 Страхування проектних ризиків. Диверсифікація та управління запасами як способи зниження проектного ризику.</b> 1) Страхові випадки проектних ризиків та відшкодування збитків при їх настанні. 2) Диверсифікація в проектній діяльності – сутність, види і правила. 3) Кореляція між нормами прибутку цінних паперів та її застосування.

4) Обсяг резерву продукції для безперебійного забезпечення проектів.
5) Резервування грошових засобів для покриття випадкових затрат. Модель М.Міллера і Д.Орра.

#### 4.4. План практичних занять

№	Тема заняття / план
1	<p><b>Тема 1, 2 Проектні ризики – сутність, види, класифікація, аналіз та оцінка</b></p> <p>1) Розглянути актуальність вивчення, сутність проектних ризиків. Причини їх виникнення.</p> <p>2) Розглянути основні види та класифікацію проектних ризиків.</p> <p>3) Зробити якісний і кількісний аналіз проектного ризику при різних видах проектів.</p> <p>4) Розв'язування задач на кількісний аналіз проектного ризику.</p> <p>5) Провести тестове опитування по темі.</p>
2	<p><b>Тема 3,4 Управління проектними ризиками. Транспортні ризики та їх хеджування</b></p> <p>1) Розглянути основні принципи управління проектним ризиком.</p> <p>2) Проаналізувати блок-схему процесу управління проектним ризиком.</p> <p>3) Розглянути застосування зовнішніх і внутрішніх способів зниження проектного ризику.</p> <p>4) Розглянути класифікацію транспортних ризиків за Міжнародною торгівельною палатою.</p> <p>5) Аналіз конкретних ситуацій перерозподілу транспортного ризику між продавцем і покупцем продукції.</p> <p>6) Провести тестове опитування по темі.</p>
3	<p><b>Тема 5, 6 Ризик проектів реального інвестування. Ризик проектів фінансового інвестування. Основи теорії портфеля.</b></p> <p>1) Розглянути принципи, показники та методи оцінки ризиків інвестиційних проектів.</p> <p>2) Розв'язування задач на визначення показників та різних методів оцінки ризиків інвестиційних проектів.</p> <p>3) Розглянути фінансове інвестування: сутність, мету і завдання.</p> <p>4) Основні показники оцінки ризику цінних паперів.</p> <p>5) Розв'язування задач на визначення показників оцінки ризику цінних паперів.</p> <p>6) Розглянути теорію управління портфелем цінних паперів.</p> <p>7) Розв'язування задач на визначення структури портфеля цінних паперів з різною кількістю їх видів для оптимізації рівня ризику.</p>
4	<p><b>Тема 7, 8, 9 Страхування проектних ризиків. Диверсифікація та управління запасами як способи зниження проектного ризику.</b></p> <p>1) Розглянути страхові випадки проектних ризиків.</p> <p>2) Розв'язування задач на визначення розміру відшкодування збитків при страхуванні проектних ризиків.</p> <p>3) Розглянути диверсифікацію в проектній діяльності – сутність, види і правила.</p> <p>4) Розглянути кореляцію між нормами прибутку цінних паперів.</p> <p>5) Розв'язування задач на визначення кореляції між нормами прибутку цінних паперів та оптимальної структури портфеля цінних паперів.</p> <p>6) Розв'язування задач по визначенню обсягу резерву продукції для безперебійного забезпечення проектів.</p> <p>7) Розв'язування задач за допомогою моделі М.Міллера і Д.Орра.</p> <p>8) Провести тестове опитування по темі.</p>

#### 4.5. Завдання для самостійної роботи



Завдання для аналітичної роботи (денна форма), контрольної роботи (заочна форма) з дисципліни «Управління проектними ризиками»

Аналітична робота з дисципліни – є видом поза аудиторної самостійної роботи студента навчального, навчально-дослідного чи проектно-конструкторського характеру, що виконується на основі самостійного вивчення частини програмового матеріалу або його систематизації та узагальнення, для практичного застосування.

Мета. Самостійне вивчення частини програмного матеріалу, систематизація, поглиблення, узагальнення, закріплення та практичне застосування знань з навчального курсу та розвиток навичок самостійної роботи.

Зміст. Аналітична робота – це завершена теоретико-практична робота в межах навчальної програми курсу «Управління проектними ризиками», яка виконується на основі знань, умінь і навичок, одержаних в процесі лекційних, семінарських, практичних занять, охоплює декілька тем або зміст навчального курсу в цілому.

Вибір та затвердження теми

Важливим елементом у написанні аналітичної роботи є вибір теми, тобто проблеми дослідження. Слід пам'ятати, що від правильного обрання теми та складеного плану залежить якість виконання роботи.

Тематика аналітичної роботи розробляється на кафедрі економіки та підприємництва ЧНУ ім. Петра Могили, відповідно до навчального плану з дисципліни «Управління проектними ризиками», навчальним планом якої передбачено виконання такого виду самостійної роботи. Студенти беруть тему аналітичної роботи за номером у списку групи у переліку тем. Вони також можуть самі запропонувати тему роботи, виходячи з її актуальності, відповідності фахові, зі своїх практичних інтересів та сучасного стану розвитку досліджень, визначальних для обраної проблеми.

При розробці і виборі тем аналітичної роботи з дисципліни «Управління проектними ризиками», мають враховуватися особливості сучасної діяльності студента.

Після вибору теми студент звертається до викладача за її затвердженням. Дуже важливо, коли він сам перед тим спробує розробити план своєї теми, добре обміркує і чітко уявить собі хід її виконання, враховуючи конкретні умови, в яких йому доведеться працювати. Це дасть можливість керівникові зважити і врахувати здібності студента, його підготовленість до виконання даної роботи, а отже, зробити правильні висновки про те, яку надати йому допомогу саме там, де вона найбільш необхідна.

Аналітична робота має теоретичний, аналітичний та практичний характер. Вона пишеться на основі аналізу й узагальнення низки літературних джерел: монографій, брошур, статей, методичних рекомендацій і т. ін. Студент повинен зв'язано, грамотно і логічно обґрунтувати обрану тему, взяти з літератури основний матеріал, який стосується проблеми, що вивчається, дати оцінку вивченим роботам, висловити свою точку зору, зробити висновки.

Слід зауважити, що до студентських аналітичних робіт висувається низка вимог. Основні з них такі:

- актуальність тематики, відповідність її сучасному стану певної галузі;
- вивчення та критичний аналіз наукової і періодичної літератури з теми;
- вивчення та характеристику історії досліджуваної проблеми та її практичного стану, а також передового (при наявності - й власного) досвіду;
- наявність чіткої характеристики об'єкта, предмета, мети і завдань, методів дослідження, опис та аналіз проведених автором емпіричних досліджень;
- узагальнення результатів, обґрунтування їх, висновки та практичні рекомендації.

Під час написання аналітичної роботи студент має звертатися до викладача за консультаціями, які здійснюються за графіком індивідуально-консультативної роботи.

Аналітична робота передбачає опрацювання літератури за певною темою, яка закріплюється за студентом викладачем на 1-му груповому занятті та має таку структуру:

- вступ
- основна частина
- висновки
- список використаної літератури та інформаційних джерел.

Аналітична робота виконується в електронному виді і висилається на Moodle  
Оформлення аналітичної роботи

Індивідуальна робота подається викладачу ретельно відредагованою і чітко віддрукованою на папері формату А4 (210x297 мм):

- текстовий редактор – WORD;
- шрифт — Times New Roman;
- розмір шрифту — 14 кегель;
- накреслення – звичайний;
- інтервал між рядками — полуторний;
- абзац - 5мм;
- розташування тексту роботи – вирівнювання по ширині;
- кількість символів у рядку – не менше 60;
- кількість рядків на сторінці – до 30;
- нумерація сторінок — з права верхнього поля;
- вступ, висновки, список літератури не нумерують.
- поля:

Формули, таблиці, ілюстрації нумерують послідовно в межах кожного розділу. Номер їх складається з номеру розділу і порядкового номеру таблиці (формули, ілюстрації). Наприклад: 2.2 – друга таблиця другого розділу.

Таблицю вміщують після першого згадування про неї в тексті. Над правим верхнім кутом таблиці пишуть слово «Таблиця» і вказують її номер (знак № при цьому не пишуть). Примітки до таблиці розміщують безпосередньо під таблицею. Повторні посилання на таблицю дають по формі: (див. табл. 2).

Номер формули пишуть на її рівні біля правого поля аркуша. Столпчик

пояснень до формули (експлікацію) рівняють відносно знаку тире. Значення кожного символу і числового коефіцієнта подають з нового рядка. Вище та нижче кожної формули залишають не менше одного вільного рядка.

Посилання на джерела. Аналітичну роботу пишуть як літературний огляд. Під час підготовки аналітичної роботи студент має використовувати додаткові літературні джерела: матеріали періодичних економічних видань, статистичні та аналітичні матеріали, офіційні інтернет-сторінки органів влади. Текст аналітичної роботи повинен відображати посилання на використані джерела. Посилання на джерела цитат, фактичних і статистичних даних, точки зору авторів потрібні для того, щоб можна було перевірити їх достовірність. Якщо в аналітичній роботі відсутні посилання на джерела, то вважається, що воно написане на базі одного джерела. Така робота не зараховується.

Форма посилань на джерела може бути різною. Але обов'язково посилання на джерело крім прізвища автора, назви роботи повинно мати вихідні дані, номер сторінки з тим, щоб джерело можна було легко знайти і перевірити посилання на нього.

Джерела можна розміщувати в списку в порядку появи посилань у тексті, або в алфавітному порядку прізвищ перших авторів або заголовків.

У вступі (1-2 сторінки тексту) обґрунтовують актуальність теми, мету роботи, її структуру.

Основна частина складається з теоретичної, аналітичної і рекомендаційної частин. В теоретичній частині наводяться теоретичні засади управління проектними ризиками, робиться огляд літературних джерел; в аналітичній частині висвітлюється фактичний стан певного виду проектів і ризики пов'язані з ними, проблеми управління ризиками, вітчизняний та/або зарубіжний досвід їх вирішення, роль держави (хто здійснює регулювання (суб'єкти регулювання), яким чином (методи регулювання)); рекомендаційна частина вміщає конкретні пропозиції, щодо покращення управління проектними ризиками.

Висновки узагальнюють результати теоретичної, аналітичної і рекомендаційної частин.

Максимальний обсяг аналітичної роботи - до 20-25 сторінок разом з таблицями, графічним матеріалом, додатками та списком використаної літератури.

#### Тематика аналітичних (контрольних) робіт

1. Управління проектним ризиками.
2. Ризик зовнішньоекономічній проектної діяльності підприємства.
3. Метод аналогів для кількісної оцінки проектного ризику.
4. Метод аналізу чутливості для виявлення основних чинників проектного ризику.
5. Основні види та класифікація проектних ризиків.
6. Особливості застосування заходів для зменшення проектних ризиків.
7. Ризик-менеджмент у проектній діяльності.
8. Інкотермс – міжнародні правила поставки товарів на іноземних ринках.
9. Страхування проектних ризиків в міжнародній практиці.
10. Основні ризики в інформаційних проектах.

11. Диверсифікація в проектній діяльності.
12. Використання експертних методів для оцінки проектного ризику.
13. Оцінка ризиків в інвестиційному проекті та захист від них.
14. Оцінка ризиків фінансового інвестуванні та їх оптимізація.
15. Аналіз законодавчо-нормативної бази Україні щодо проектного ризику.
16. Аналіз проектного ризику при міжнародній діяльності.
17. Історія розвитку методів оптимізації рівня проектного ризику.
18. Управління стратегією захисту від валютних ризиків в проектах з іноземними компаніями.
19. Статистичний метод для кількісної оцінки проектного ризику.
20. Моделі прогнозування валютних курсів та валютного ризику.
21. Методи антикризового управління компанією та роль резервів і запасів у цьому .
22. Моделювання резервів у зовнішньоекономічній діяльності.
23. Валютні резерви як спосіб зниження проектних ризиків та методи їх моделювання.
24. Запаси та резерви, пов'язані з проблемами зниження ступеня ризику у проектній діяльності.

### **Забезпечення освітнього процесу**

Вимагає використання мультимедійного забезпечення, зокрема, проектора на практичних заняттях (з окремих тем), wi-fi та програмного забезпечення як то Word, Excel, PowerPoint.

## **5. Підсумковий контроль**

### **Питання до іспиту**

1. Проектні ризики – сутність і природа.
2. Причини виникнення проектних ризиків.
3. Необхідність врахування дії ризику під час прийняття рішень в проектній діяльності.
4. Основні види проектних ризиків.
5. Класифікація проектних ризиків.
6. Особливості виникнення та дії різних видів проектних ризиків.
7. Поняття невизначеності в проектній діяльності. Зв'язок невизначеності та ризику.
8. Невизначеність та її види.
9. Якісний аналіз проектного ризику: сутність, алгоритм, цілі.
10. Методи кількісного аналізу проектного ризику.
11. Поняття допустимого, критичного і катастрофічного ризику.
12. Чинники впливу на ступінь ризику проектної діяльності.
13. Показники кількісної оцінки проектного ризику.
14. Статистичний метод оцінки ступеня ризику.
15. Метод аналогів.
16. Експертні методи оцінки ризиків.

17. Метод аналізу чутливості.
18. Метод аналізу доцільності витрат.
19. Комплексна оцінка ризиків.
20. Оцінка ризиків на основі аналізу точки беззбитковості.
21. Оцінка ризику в абсолютному вираженні.
22. Оцінка ризику в відносному вираженні.
23. Необхідність управління проектним ризиком у спектрі економічних проблем.
24. Загальні підходи до процесу управління проектним ризиком.
25. Методи управління ризиком: уникнення ризику; попередження (запобігання) виникнення ризику; прийняття ризику; зниження ступеня ризику.
26. Основні принципи управління проектним ризиком.
27. Узагальнена блок-схема управління проектним ризиком.
28. Зовнішні способи оптимізації ступеня проектного ризику.
29. Внутрішні способи оптимізації ступеня проектного ризику.
30. Класифікація транспортних ризиків за Міжнародною торгівельною палатою.
31. Перерозподіл відповідальності за продукцію згідно класифікації транспортних ризиків.
32. Критерії обґрунтування рішень під час вибору інвестиційного проекту.
33. Дохідність інвестиційного проекту з урахуванням ризику. Ставка дисконтування.
34. Сутність управління портфелем цінних паперів.
35. Норма прибутку та показники оцінки ризику цінних паперів.
36. Коефіцієнт кореляції двох цінних паперів та її застосування.
37. Портфель з двох звичайних акцій, оцінка та оптимальна структура.
38. Портфель з багатьох акцій. Множина допустимих портфелів та коефіцієнти кореляції.
39. Множина ефективних портфелів з багатьох цінних паперів.
40. Загальні основи теорії портфеля. Модель Шарпа.
41. Систематичний та специфічний ризик цінних паперів. Коефіцієнт  $\beta$ .
42. Модель дерева рішень.
43. Страхові випадки проектних ризиків.
44. Види страхування які покривають проектні ризики.
45. Механізм відшкодування збитків при страхуванні проектних ризиків.
46. Диверсифікація в проектній діяльності, сутність і види.
47. Основні правила диверсифікації.
48. Структура та види резервів та запасів на непередбачувані затрати.
49. Резервування грошових засобів на покриття непередбачуваних затрат.
50. Управління запасами з урахуванням ризику.
51. Модель М. Міллера і Д. Орра.
52. Модель формування оптимального резерву.

### Типові тести для відповіді

1. Які з видів ризиків можуть призвести як до збитків, так і до доходів:
  - а) статичний;
  - б) динамічний;
  - в) спекулятивний;
  - г) чистий.
2. У чому полягає аналіз ризику?
  - а) Оцінка ризику;
  - б) зменшення ризику;
  - в) ідентифікація ризику;
  - г) уникнення ризику;
  - д) діагностика ризику;
  - е) пізнання ризику.

### Типові задачі для розв'язування

**Задача 1.** Підприємство освоює проект випуску пральних машин в невеликих обсягах. При цьому можливі збитки як результат недостатньо вивченого попиту. 700 тис. грн. з ймовірністю 0,4; 500 тис. грн. з ймовірністю 0,5 і 300 тис. грн. несподіваний дохід з ймовірністю 0,1. Визначте ступінь ризику підприємства за показником сподіваних збитків.

**Задача 2.** Акції виду  $A_1$ ,  $A_2$ ,  $A_3$  мають, відповідно, сподівані норми прибутку 20%, 40% та 60%, середньоквадратичні відхилення 10%, 18% та 30%, коефіцієнти кореляції  $\rho_{12} = 1$ ,  $\rho_{13} = -1$ ,  $\rho_{23} = -1$ . Необхідно:

- а) побудувати множини допустимих та ефективних портфелів цінних паперів (ПЦП);
- б) визначити структуру ПЦП, що має найбільшу сподівану норму прибутку при мінімальному ризику;
- в) обчислити сподівану норму прибутку та величину ризику для отримання ПЦП.

### Чорноморський національний університет імені Петра Могили

Рівень вищої освіти: другий (магістерський)

Галузь знань 07 «Управління та адміністрування»

Спеціальність 076 «Підприємництво, торгівля і біржова діяльність»\_ Семестр ІХ

Навчальна дисципліна Д4 Управління проектними ризиками

### ЕКЗАМЕНАЦІЙНИЙ БІЛЕТ №0

1. Проектні ризики – сутність і природа. (13 балів).
2. Узагальнена блок схема управління проектним ризиком. (13 балів).
3. Задача (14 балів).

Акціонерному товариству пропонується два ризикованих проекти :

	Проект 1			Проект 2		
Ймовірність події	0,2	0,6	0,2	0,4	0,2	0,4
Надходження готівкою, млн. грн.	40	50	60	0	50	100

Який з проектів менш ризиковий. Враховуючи, що фірма має фіксовані платежі по боргам 80 млн. грн., який проект повинні обрати акціонери

Затверджено на засіданні  
кафедри економіки підприємства

Протокол № \_\_\_\_\_ від „\_\_\_\_\_” \_\_\_\_\_ 20\_\_ року

Завідувач кафедри економіки  
підприємства

Екзаменатор

\_\_\_\_\_ (підпис)

\_\_\_\_\_ (підпис)

Кузьменко О.Б.,

Кузьменко О.Б.

**Проведення підсумкового контролю знань.** Результатом вивчення дисципліни виступає екзамен. Умовою допуску до підсумкового контролю знань є позитивні оцінки з поточного контролю знань. Контроль знань студентів здійснюється за 100-бальною шкалою. Максимальну кількість балів, яку може отримати студент протягом семестру становить 60 балів. На екзамені максимальна кількість балів - 40 балів.

Екзаменаційний білет складається з двох теоретичних питань та задачі, за правильну відповідь на перше та друге питання студент отримує по 13 балів, а за розв'язану задачу 14 балів.

## 6. Методи навчання

Пояснювально-ілюстративний метод: застосовується при викладанні лекцій. Студенти сприймають і осмислюють факти, оцінки, висновки.

Частково-пошуковий (евристичний) метод: застосовується при відповіді на тести, питання, розв'язуванні задач, виконанні аналітичної роботи. Студенти осмислюють умови тесту, задачі, аналітичної роботи, актуалізують отримані раніше знання та навички, самостійно вирішують, аналізують, порівнюють, роблять висновки, узагальнюють, перевіряють результати роботи.

## 7. Критерії оцінювання та засоби діагностики результатів навчання

### Денна форма

№	Вид діяльності (завдання)	Максимальна кількість балів
1	Тести (15×1б)	15
2	Опитування (18×1б)	18
3	Розв'язування задач (17×1б)	17
4	Аналітична робота (1×10б)	10
5	Екзамен (1×40б)	40
	<b>Всього</b>	<b>100</b>

### Критерії оцінки знань студентів.

Тести: правильна буква відповіді на один тест – 1 бал, неправильна – 0 балів.

Опитування: правильна відповідь в повному обсязі на поставлене питання – 1 бал, інші варіанти – 0 балів.

Розв'язування задач: правильно розв'язана одна задача, оформлена в зошиті, з ходом рішення і у встановлений термін – 1 бал; задача не розв'язана вірно – 0 балів.

Аналітична робота: виконана у встановлений термін, згідно всіх вимог і без зауважень – 10 балів; виконана з незначним порушенням терміну, має зауваження по оформленню, списку літератури або суто арифметичні помилки у розрахунках – 5 балів; виконана зі значним порушенням терміну, має суттєві зауваження в теоретичній, аналітичній або рекомендаційній частинах – 3 бали; не виконана робота – 0 балів

#### Заочна форма

№	Вид діяльності (завдання)	Максимальна кількість балів
1	Тести (20×1б)	20
2	Опитування (4×1б)	4
3	Розв'язування задач (3×2б)	6
4	Контрольна робота (1×30б)	30
5	Екзамен (1×40б)	40
	<b>Всього</b>	<b>100</b>

#### Критерії оцінки знань студентів.

Тести: правильна буква відповіді на один тест – 1 бал, неправильна – 0 балів.

Опитування: правильна відповідь в повному обсязі на поставлене питання – 1 бал, інші варіанти – 0 балів.

Розв'язування задач: правильно розв'язана одна задача, оформлена в зошиті, з ходом рішення і у встановлений термін – 2 бали; задача розв'язана з суто арифметичними помилками, які не вплинули на хід рішення та незначним перевищенням терміну – 1 бал; інші варіанти – 0 балів.

Контрольна робота: виконана у встановлений термін, згідно всіх вимог і без зауважень – 30 балів; виконана з незначним порушенням терміну, має зауваження по оформленню, списку літератури або суто арифметичні помилки у розрахунках – 20 балів; виконана зі значним порушенням терміну, має суттєві зауваження в теоретичній, аналітичній або рекомендаційній частинах – 10 балів; не виконана робота – 0 балів

#### Матеріально-технічне забезпечення дисципліни

Проекційне мультимедійне обладнання (проектор, екран, ноутбук/комп'ютер);

Доступ до мережі Internet, точка доступу Wi-Fi;

OS: Windows, Android, iOS;

Browsers: Chrome / Opera / Mozilla Firefox / MS Edge;

Програмне забезпечення: GantProject, Word, Excel, PowerPoint; Skype, Zoom, Google Meet;

Система електронного навчання Moodle 3.9



## 8. Рекомендовані джерела інформації

### 8.1. Основні:

1. Економічний ризик: методи оцінки та управління [Текст] : навч. посібник / [Т. А. Васильєва, С. В. Леонов, Я. М. Кривич та ін.] ; під заг. ред. д-ра екон. наук, проф. Т. А. Васильєвої, канд. екон. наук Я. М. Кривич. – Суми : ДВНЗ “УАБС НБУ”, 2015. – 208 с.
2. Кузьменко О.Б. Управління проектами: [методичні рекомендації для самостійного вивчення дисципліни та виконання контрольної роботи] / О.Б. Кузьменко, Б.П. Кузьменко. – Миколаїв: Вид-во ЧДУ ім. Петра Могили, 2016. – 44 с. (Методична серія; Вип. 244).
3. Петренко Н. О. Управління проектами [текст] навчальний посібник. / Н. О. Петренко, Л. О. Кустріч, М. О. Гоменюк. – К. : «Центр учбової літератури», 2015. – 244 с.
4. Посохов І.М. Управління ризиками у підприємстві: навчальний посібник \ І. М. Посохов. – Харків : НТУ «ХП», 2015. – 220 с.

### 8.2. Додаткові:

5. Вітлінський В.В., Верченко П.І. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком.- Навч. посібник / В.В. Вітлінський, П.І. Верченко. – Київ: КНЕУ, 2000р. – 292с.
6. Донець Л.І. Економічні ризики та методи їх вимірювання: Навчальний посібник / Л.І. Донець . — К.: Центр навчальної літератури, 2006. — 312 с.
7. Кузьменко О.Б. Управління ризиком: Збірник завдань для виконання контрольної роботи студентами заочної форми навчання спеціальності 6.050104 «Фінанси» / О.Б. Кузьменко – Миколаїв: Вид-во МДГУ ім. Петра Могили, 2008. – Вип.94. – 44 с.
8. Кучеренко В.Р. Економічний ризик та методи його вимірювання: Навчальний посібник / В.Р. Кучеренко, В.А. Карпов, А.В. Карпов. – Одеса, 2011. – 199с.
9. Ліщинський О.Л. Економічний ризик та методи його вимірювання: Навч. посібник для вузів / О.Л. Ліщинський: Київ. ЦНЛ. – 2005 р.
10. Матвійчук А.В. Аналіз і управління економічним ризиком: Навч. посібник для вузів / А.В. Матвійчук. Київ.: ЦНЛ – 2005 р.
11. Машина М.І. Економічний ризик та методи його вимірювання: навч. посібник / М.І. Машина.– Київ: Центр навчальної літератури, 2005 .– 188с.
12. Офіційний веб-портал Верховної ради України. Режим доступу: <https://rada.gov.ua/news/zak>