

**МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
СХІДНОУКРАЇНСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
імені ВОЛОДИМИРА ДАЛЯ**

**С. А. НЕСТЕРЕНКО,
Л. В. МАРТИНОВА,
А. А. МАРТИНОВ**

**ІНСТРУМЕНТАРІЙ УПРАВЛІННЯ
РИЗИКАМИ ДІЯЛЬНОСТІ ПІДПРИЄМСТВ
ЗЕРНОПРОДУКТОВОГО ПІДКОМПЛЕКСУ**



**Сєверодонецьк
2019**

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
СХІДНОУКРАЇНСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
імені ВОЛОДИМИРА ДАЛЯ

С. А. НЕСТЕРЕНКО,
Л. В. МАРТИНОВА,
А. А. МАРТИНОВ

**ІНСТРУМЕНТАРІЙ УПРАВЛІННЯ
РИЗИКАМИ ДІЯЛЬНОСТІ
ПІДПРИЄМСТВ ЗЕРНОПРОДУКТОВОГО
ПІДКОМПЛЕКСУ**

Монографія

Сєвєродонецьк
2019

УДК 330.131.7:338.439
Н56

Рекомендовано до друку Вченою радою Східноукраїнського
національного університету імені Володимира Даля
(протокол № 2 від 25.10.2019 року)

Рецензенти:

Васильківський Д. М., д.е.н., доцент, завідувач кафедри міжнародних економічних відносин Хмельницького національного університету
Судомир С. М., д.е.н., доцент, професор кафедри економіки підприємства ВП НУБіП України «Бережанський агротехнічний інститут»

Нестеренко С. А.

Н56 Інструментарій управління ризиками підприємств зернопродуктового підкомплексу : монографія / С. А. Нестеренко, Л. В. Мартинова, А. А. Мартинов. – Северодонецьк: вид-во СНУ ім. В. Даля, 2019. – 188 с.

ISBN 978-617-11-0149-4

У монографії викладено теоретико-методичні аспекти щодо удосконалення інструментарію управління ризиками на підприємствах зернопродуктового підкомплексу, що забезпечує підвищення рівня обґрунтованості управлінських рішень в умовах дії факторів ризику. Досліджено сутність, методи та проблеми управління ризиками господарської діяльності на підприємствах зернопродуктового підкомплексу. Визначено особливості інформаційно-аналітичного забезпечення управління ризиками. Запропоновано інструментарій комплексної оцінки ризиків господарської діяльності із використанням компоненту оцінки ризику втрати платоспроможності підприємства на основі використання інтегровальних фінансових моделей. Сформовано математичний інструментарій комплексної експертної оцінки ризику та розроблено інструментарій формування адаптивної стратегії управління ризиками господарської діяльності на підприємствах зернопродуктового підкомплексу.

Монографія призначена для студентів, аспірантів, наукових співробітників, викладачів, практикуючих спеціалістів підприємств.

УДК 330.131.7:338.439

© Нестеренко С. А., Мартинова Л. В.,
Мартинов А. А., 2019

© Східноукраїнський національний
університет імені Володимира Даля, 2019

ISBN 978-617-11-0149-4

ЗМІСТ

ВСТУП	4
Розділ I. ТЕОРЕТИЧНИЙ БАЗИС ФОРМУВАННЯ ІНСТРУМЕНТАРІЮ УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ ДІЯЛЬНОСТІ НА ПІДПРИЄМСТВАХ ЗЕРНОПРОДУКТОВОГО ПІДКОМПЛЕКСУ	6
1.1. Передумови, економічний зміст та фактори ризику діяльності підприємств зернопродуктового підкомплексу	6
1.2. Методи управління ризиками діяльності на підприємствах зернопродуктового підкомплексу	21
1.3. Проблеми та тенденції розвитку зернопродуктового підкомплексу України в контексті антиризикового управління	33
Висновки до розділу I	46
Розділ II. АНАЛІЗ СИСТЕМИ УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ ДІЯЛЬНОСТІ ПІДПРИЄМСТВ ЗЕРНОПРОДУКТОВОГО ПІДКОМПЛЕКСУ	49
2.1. Інформаційно-аналітичне забезпечення управління ризиками діяльності підприємств	49
2.2. Інструментарій оцінки ризику втрати платоспроможності підприємств зернопродуктового підкомплексу на основі використання інтегральних фінансових моделей	60
2.3. Комплексна оцінка ризиків діяльності підприємств зернопродуктового підкомплексу	82
Висновки до розділу II	102
Розділ III. ШЛЯХИ УДОСКОНАЛЕННЯ ІНСТРУМЕНТАРІЮ УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ ДІЯЛЬНОСТІ НА ПІДПРИЄМСТВАХ ЗЕРНОПРОДУКТОВОГО ПІДКОМПЛЕКСУ	105
3.1. Напрями удосконалення системи управління ризиками діяльності на підприємствах зернопродуктового підкомплексу	105
3.2. Формування математичного інструментарію комплексної експертної оцінки ризиків діяльності на підприємствах зернопродуктового підкомплексу	124
3.3. Розробка інструментарію формування адаптивної стратегії управління ризиками діяльності підприємств зернопродуктового підкомплексу на основі теорії ігор ..	135
Висновки до розділу III	155
ВИСНОВКИ	157
СПИСОК ВИКОРИСТАНИХ ДЖЕРЕЛ	161
ДОДАТКИ	171