

**НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ БІОРЕСУРСІВ І
ПРИРОДОКОРИСТУВАННЯ УКРАЇНИ**

Факультет аграрного менеджменту



«ЗАТВЕРДЖУЮ»

Проректор з науково-педагогічної
роботи та розвитку

С.М. Кваша

2021 р.

РОЗГЛЯНУТО І СХВАЛЕНО

на засіданні вченої ради
факультету аграрного менеджменту
Протокол № 10 від 09.06 2021 р.
Декан факультету аграрного менеджменту
А.Д. Остапчук

на засіданні кафедри менеджменту
ім. проф. Й.С. Завадського
Протокол № 14 від «27» травня 2020 р.

Завідувач кафедри
Т.І. Балановська
«27» травня 2021 р.

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТ В АГРАРНІЙ СФЕРІ

Рівень вищої освіти – третій (освітньо-науковий)

Галузь знань – 07 «Управління та адміністрування»

Спеціальність – 073 «Менеджмент»

Освітньо-наукова програма «Менеджмент»

Гарант ОНП: Балановська Т.І.

Розробники: д.е.н., професор Резнік Н.П.

Київ - 2021

1. Опис навчальної дисципліни
«РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТ В АГРАРНІЙ СФЕРІ»

Галузь знань, напрям підготовки, освітньо-кваліфікаційний рівень		
Галузь знань	07 Управління та адміністрування	
Спеціальність	073 Менеджмент	
Освітньо-наукова програма	Менеджмент	
Освітній ступінь	Доктор філософії	
Характеристика навчальної дисципліни		
Вид	Вибіркова	
Загальна кількість годин	150	
Кількість кредитів ECTS	5	
Кількість змістовних модулів		
Форма контролю	Іспит	
Показники навчальної дисципліни для денної та заочної форми навчання		
	Денна	Заочна
Рік підготовки (курс)	2	2
Семестр	3	3
Лекційні заняття	20	20
Семінарські, <u>практичні</u> заняття	30	30
Самостійна робота	100	100
Кількість тижневих аудиторних годин	5	5

2. Мета та завдання навчальної дисципліни

Головна **мета дисципліни** «Ризик-менеджмент в аграрній сфері» – полягає в отриманні PhD студентами теоретичних знань і практичних знань в галузі оцінки та управління ризиком на підприємстві в аграрній сфері, що сприяє розвитку у PhD студентів навичок комплексної оцінки і діагностики ефективності підприємства в цілому.

Завданням дисципліни: є вивчення методичного матеріалу з ризик- менеджменту, який формує точку зору PhD студента в сфері управління ризиками та дозволить ґрунтовно сформулювати у майбутнього фахівця практичні навички у використанні хеджових механізмів управління цінovими ризиками при здійсненні бізнесової діяльності на підприємствах в аграрній сфері. Засвоїти методи запобігання ризику і ухилення від нього, зниження невизначеності; вивчити класифікацію існуючих ризиків, освоїти, а також визначати його вартість на різних етапах господарської діяльності підприємств аграрної сфери. Освоїти практичні аспекти з організації торгівлі ф'ючерсними, опціонними контрактами та свопами на сільськогосподарські товари з метою оптимізації ризиків в сільськогосподарській діяльності. Набуття PhD студентами практичних навичок розв'язання завдань щодо управління ризиками та виконання відповідних функцій, виховання здатності до творчого пошуку, пошуку ефективних напрямів, резервів і ресурсів удосконалення функціонування організацій і підприємств за рахунок забезпечення ефективного та результативного ризик-менеджменту.

У результаті вивчення навчальної дисципліни PhD студенти повинні **знати:**

- основні поняття і завдання ризик менеджменту;
- знати концептуальні основи ризик-менеджменту;
- ідентифікувати ризики;
- аналізувати (якісно та кількісно) ризики;
- ранжувати ризики;
- застосовувати сучасні методи боротьби з ризиками;
- планувати послідовність дій по управлінню ризиками;
- оцінювати ефективність запланованих протиризикових заходів;
- приймати рішення щодо вибору протиризикових заходів;
- методи виявлення, оцінки та аналізу рівня ризиків, управління ризиками;
- сутність ризиків у діяльності підприємств аграрної сфери;
- основні види та класифікації ризиків;
- особливості застосування інструментів хеджування ризиків в аграрній сфері;
- методи збору та статистичної обробки інформації;
- нормативно-правову базу та систему хеджових операцій на агропродовольчому ринку;
- технологію здійснення хеджових, арбітражних, спекулятивних операцій на біржовому агропродовольчому товарному ринку;
- дієві та продуктивні механізми управління цінovими ризиками в аграрній сфері;
- моделі руху базису на товарному біржовому ринку та використання його для прогнозування цінovого ризику на ринку агропродовольчої продукції;
- види та особливості хеджових, арбітражних, спекулятивних торговельних стратегій;
- економічний механізм хеджових операцій.

уміти:

- аналізувати та ідентифікувати ризики в аграрній сфері;
- використовувати математичні та статистичні методи розрахунку рівня ризиків;
- користуватися інструментами ризик-менеджменту;
- використовувати статистичні засоби аналізу ризиків в аграрній сфері;
- оволодіти навичками самостійно здійснювати якісний аналіз, ідентифікацію ризику і проводити відповідні обчислення, використовуючи сучасне програмне забезпечення та відповідні програмно-методичні комплекси;
- здійснювати оцінку міри ризику за певними адекватними цілям і системі прийнятих гіпотез кількісними показниками;

- контролювати, моделювати й враховувати ризик, управляти ним, застосовуючи відповідні способи, які є в арсеналі економічної ризикології;
- визначати рівень прибутковості торгівлі базисом, волатильність цін на ринках;
- здійснювати хеджування на ф'ючерсних ринках агропродовольчої продукції для страхування ризиків сільськогосподарських товаровиробників, пов'язаних зі змінами цін при виробництві, зберіганні, переробці та реалізації продукції аграрної сфери;
- досконало володіти стратегіями купівлі та продажу опціонів на ринку агропродовольчої продукції.

Набуття компетентностей:

загальні компетентності (ЗК):

ЗК2. Здатність до критичного мислення, пошуку, опрацювання, генерування нових складних ідей, аналізу, синтезу та встановлення взаємозв'язків між явищами та процесами.

ЗК3. Здатність до організації та проведення оригінальних наукових досліджень, оцінювання і забезпечення якості виконуваних робіт, приймання обґрунтованих рішень та генерування нових ідей.

спеціальні (фахові) компетентності (СК):

СК1. Здатність до пошуку, обробки, аналізу та узагальнення інформації для проведення самостійних наукових досліджень у сфері менеджменту.

СК3. Здобуття глибинних знань з менеджменту, зокрема розуміння теоретичних і практичних проблем, історії розвитку та сучасного стану наукових знань, критичного аналізу основних концепцій, оволодіння науковою термінологією.

програмні результати навчання (ПРН):

ПРН2. Організовувати та проводити оригінальні наукові дослідження з менеджменту на відповідному фаховому рівні з використанням сучасних інструментів, критично аналізувати результати інших дослідників у контексті усього комплексу сучасних знань щодо досліджуваної проблеми, досягати наукових результатів, що створюють нові знання для розв'язання актуальних проблем теорії та практики.

ПРН4. Ініціювати, розробляти та реалізовувати наукові та/або інноваційні проекти у сфері менеджменту, управляти ними та здійснювати пошук партнерів для їх реалізації в різних галузях економіки на мікро-, мезо- та макrorівнях.

ПРН7. Здійснювати критичний аналіз, узагальнювати результати наукових досліджень, формулювати та обґрунтовувати висновки і пропозиції щодо розвитку концептуальних і методологічних знань у сфері менеджменту.

ПРН12. Ухвалювати обґрунтовані управлінські рішення на рівні підприємств, секторів національної економіки, саморозвиватися і самовдосконалюватися, нести відповідальність за достовірність і новизну власних наукових досліджень та ухвалення рішень, вміти мотивувати співробітників рухатися до спільної мети.

Програма навчальної дисципліни

ТЕМА I. Основні аспекти та тенденції ризик-менеджменту. Класифікація ризиків.

Основні визначення і поняття ризик-менеджменту. Процеси управління ризиком. Категорії «ризик» і «прибутковість». Позиції застосування ризик-менеджменту. Основні елементи і етапи управління ризиком. Маніпулювання ризиком. Глобальні завдання в області управління ризиками: застосування ризик менеджменту; управління ризиками по їх типам; точність оцінок ризиків. Функції ризик-менеджменту в аграрній сфері. Організація ризик-менеджменту. Поняття: інтуїція, інсайт, евристика. Правила ризик-менеджменту. Розрахунок коефіцієнта ризику. Функції відділу ризикових вкладень капіталу. Інформаційне забезпечення функціонування ризик-менеджменту. Рекомендований перелік документів, що характеризують фінансовий стан організації.

Класифікація ризиків за їх функціональної спрямованості. Чисті і спекулятивні ризики. Виробничий ризик. Комерційний ризик. Фінансовий ризик. Ризики залежності від основної причини їх виникнення. Ризики, пов'язані з купівельною спроможністю грошей. Інвестиційні ризики. Виробничий ризик. Комерційний ризик. Фінансовий ризик. Селективні ризики. Ризик банкрутства. Біржові ризики. Валютний ризик. Регіональний

ризик. Галузевий ризик. Інноваційний ризик. Ризики невиконання господарських договорів. Ризики зміни ринкової кон'юнктури і посилення конкуренції. Ризики виникнення непередбачених витрат і зниження доходів. Ризики втрати майна підприємницької організації. Ризик незатребуваності продукції. Форс-мажорні ризики.

ТЕМА 2. Аналіз і оцінка ступенів ризику.

Ідентифікація та концептуальні напрями аналізу ризиків. Якісний аналіз. Кількісна оцінка. Етапи ідентифікації та аналізу ризиків. Принципи інформаційного забезпечення системи управління ризиком. Корисність інформації. Ефективність управління ризиком. Доступність інформації. Достовірність інформації. Загальні групи джерел інформації при аналізі конкретних ризиків. Інформаційна система, яка обслуговує процес управління ризиками. Візуалізація ризиків. Прийоми візуалізації ризиків. Щільність розподілу в зв'язку з реалізацією попереджувального заходу. Концепція прийнятного ризику. Граничні значення ризику. Ризиковий капітал. Система невизначеностей. Повна невизначеність. Повна визначеність. Часткова невизначеність. Критерії визначення оптимальності в сфері невизначеності. Визначення ступеня ризику. Методи оцінки ризику: кількісний і якісний. Внутрішня норма прибутковості (IRR); очікувана норма прибутковості (ERR). Коефіцієнт варіації (CV). Нормальний розподіл ймовірностей і крива ризиків. Емпірична шкала допустимого рівня ризику. Крива ризиків. Методи експертних оцінок при визначенні ступеня ризику. Концепція ризикової вартості (Value at risk - VAR). Ключові параметри визначення ризикової вартості (VAR). Об'єктивний метод встановлення довірчого інтервалу і часового горизонту. Традиційні техніки апроксимації розподілу $R_t(T)$: параметричний метод; моделювання за історичними даними; метод Монте-Карло; аналіз сценаріїв.

ТЕМА 3. Управління ризиками, як система менеджменту.

Процес управління ризиками на підприємстві та його етапи. Ідентифікація та аналіз ризику. Аналіз альтернатив управління ризиком. Методи мінімізації негативного впливу несприятливих подій. Класифікація методів управління ризиками. Вибір методів управління ризиком. Виконання обраного методу управління ризиком. Моніторинг результатів і вдосконалення системи управління змiст ризиком. Методи управління ризиками (чотири групи). Методи ухилення від ризику. Схема методів управління ризиками. Обмеження застосування методів управління ризиками. Основні реквізити страхового поліса або свідчення. Основні контракти, що укладаються при передачі ризику. Методи локалізації та дисипації ризику. Чотири основні види інтеграції як спосіб мінімізації ризику. Диверсифікація як різновид методів дисипації ризику. Види диверсифікації. Методи компенсації ризику як попереджувальні методи управління ризиками. Зниження підприємницьких ризиків. Методи перевірки ділових партнерів: правила п'яти «С». Управління інформаційними ризиками. Групи інформаційних ризиків. Методи фінансування ризиків і схема їх класифікації. Покриття збитку з поточного доходу (Current expensing of losses). Покриття збитку з резервів (Reserving). Покриття збитку за рахунок використання позики (Borrowing). Покриття збитку на основі самострахування (Self-insurance). Створення кептінових страхових організацій (captive insurance). Покриття шкоди за рахунок передачі відповідальності на основі договору (Contractual transfer). Покриття збитку на основі підтримки державних або муніципальних органів (Budget support). Покриття збитку на основі спонсорства (Sponsorship).

ТЕМА 4. Галузеве управління ризиками.

Управління сільськогосподарськими ризиками. Класи джерел інформаційної невизначеності. Підхід до управління ризиками Ф. Найта, заснований на математичній базі для кількісного виміру. Визначення аграрного ризику. Види с/г ризиків. Показники ризикованості. Базова схема проведення оцінки ризикованості підприємницької діяльності в аграрній сфері. Методика і основні етапи оцінки ризикованості підприємницької діяльності в аграрній сфері. Управління ризиками, що виникають при лізинговому інвестуванні. Страховий захист учасників лізингової угоди. Превентивні і підтримують заходи ризик-стратегій. Матриця стратегічного потенціалу. Ризик-менеджмент в сфері

агропромислового виробництва. Хеджування ризиків. Форвардні і ф'ючерсні контракти. Опціони. Страхування або хеджування. Модель хеджування.

ТЕМА 5. Характеристика основних видів ризику на вітчизняному ринку агропродовольчої продукції.

Розмаїтість типів і видів термінових біржових інструментів. Терміновий біржовий ринок. Роль біржі у страхуванні ризиків. Ризик сторони по угоді. Ризик процентної ставки. Ціновий ризик. Ризик ліквідності. Системний ризик. Ймовірність збитків за форвардними й ф'ючерсними контрактами обмінюється на ймовірність виграшу без негайної сплати ціни ризику покупцем продавцеві. Визначення ризику в бізнесі. Страхування від збитку, викликаного зупинкою виробництва внаслідок різних причин.

ТЕМА 6. Ф'ючерсна торгівля на ринках аграрної сфери.

Взаємодія ф'ючерсних і спотових ринків. Торгівля на спотовому та ф'ючерсному ринку. Використання ф'ючерсів для управління ризиками. Використання ф'ючерсів для спекуляції. Використання ф'ючерсів для прогнозування цін. Використання ф'ючерсів для інформаційних цілей. Стандартний розмір ф'ючерсів на аграрну продукцію на американському ринку. Зобов'язання, що передбачають ф'ючерсні контракти. Види хеджерів на аграрному ринку. Основні складові торгівлі ф'ючерсами. Технології ф'ючерсної торгівлі. Леверидж. Способи виконання ф'ючерсів в аграрній сфері.

ТЕМА 7. Основні стратегії хеджування на ринку агропродовольчої продукції.

Зниження кредитних і цінових ризиків на ринку сільськогосподарської продукції та інших товарних активів. Ціль продажної стратегії хеджування на аграрному ринку. Купівельна стратегія хеджування на аграрному ринку. Позиції при початку продажної стратегії хеджування. Контракти на біржовому ринку для продажної стратегії хеджування на аграрному ринку. Контракти на біржовому ринку для купівельної стратегії хеджування на аграрному ринку. Купівельна хеджуюча стратегія без базисних змін при падінні ціни. Продажна хеджуюча стратегія без базисних змін при зростанні ціни. Купівельна хеджуюча стратегія без базисних змін при зростанні ціни. Продажна хеджуюча стратегія без базисних змін при послабленні базису.

ТЕМА 8. Хеджування опціонами на агропродовольчу продукцію.

Контракт, що містить права продати. Контракт, що містить зобов'язання купити. Опціон пут. Опціон кол. Випадки, коли може змінюватися базис. Мета використання опціонів. Залежність базисних змін. Опціон: «при грошах», «при своїх», «без грошей». Премія за опціоном. Складові опціонної премії.

**3. Структура навчальної дисципліни
«Ризик-менеджмент в аграрній сфері»**

№	Назви змістовних модулів і тем	Кількість годин											
		денна форма						заочна форма					
		усього	у тому числі					усього	у тому числі				
			л	с	п		с.р.		л	с	п	інд	с.р.
1.	Основні аспекти та тенденції ризик-менеджменту. Класифікація ризиків.	20	4		4		12	20	4		4		12
2.	Аналіз і оцінка ступенів ризику	18	2		4		12	18	2		4		12
3.	Управління ризиками, як система менеджменту	18	2		4		12	18	2		4		12
4.	Галузеве управління ризиками	18	2		4		12	18	2		4		12
5.	Характеристика основних видів ризику на вітчизняному ринку агропродовольчої продукції	22	4		4		14	22	4		4		14
6.	Ф'ючерсна торгівля на ринках аграрної сфери	18	2		4		12	18	2		4		12
7.	Основні стратегії хеджування на ринку агропродовольчої продукції.	18	2		4		12	18	2		4		12
8.	Хеджування опціонами на агропродовольчу продукцію	18	2		2		14	18	2		2		14
Усього годин		150	20		30		100	150	20		30		100

4. Теми семінарських занять
(не передбачено навчальним планом)

5. Теми практичних занять

№ п/п	Назва теми	Кількість годин
1	Основні аспекти тенденції ризик-менеджменту. Класифікація ризиків.	4
2	Аналіз і оцінка ступенів ризику	4
3	Управління ризиками, як система менеджменту	4
4	Галузеве управління ризиками	4
5	Характеристика основних видів ризику на вітчизняному ринку агропродовольчої продукції	4
6	Ф'ючерсна торгівля на ринках аграрної сфери	4
7	Основні стратегії хеджування на ринку агропродовольчої продукції.	4
8	Хеджування опціонами на агропродовольчу продукцію	2
	Разом	30

6. Теми лабораторних занять
(не передбачено навчальним планом)

7. Контрольні запитання, комплекти тестів для визначення рівня засвоєння знань аспірантів

1. Ризик як економічна категорія, сутність та поняття.
2. Мета і завдання ризик-менеджменту в аграрній сфері.
3. Основні риси ризику.
4. Сутність підприємницької діяльності в аграрній сфері.
5. Сутність і зміст ризик-менеджменту в аграрній сфері.
6. Функції ризику в підприємницькій діяльності аграрної сфери.
7. Класифікація підприємницьких ризиків в аграрній сфері.
8. Управління ризиком на підприємствах аграрної сфери та його мета.
9. Фінансові ризики сільськогосподарських компаній.
10. Комерційні ризики.
11. Транспортний ризик і його класифікація.
12. Виробничі ризики: особливості, фактори виникнення
13. Маркетингові та збутові ризики.
14. Ризики невиконання господарських договорів.
15. Ризик зміни ринкової кон'юнктури посилення конкуренції.
16. Ризик виникнення непередбачуваних витрат і зниження доходів.
17. Форс-мажорні ризики.
18. Принципи управління ризиками.
19. Принцип демократії за ризиком.
20. Управління ризиком: сутність, два погляди на управління ризиками.
21. Основні принципи управління ризиками.
22. Основні етапи управління ризиками.

23. Ризики страхової діяльності.
24. Диверсифікація.
25. Лімітування.
26. Самострахування.
27. Хеджування.
28. Фінансові ризики.
29. Методи управління ризиками.
30. Стратегія управління в ризик-менеджменті.
31. Тактика ризик-менеджменту.
32. Інтроверсія як властивість особистості ризик-менеджера.
33. Організація ризик-менеджменту на підприємстві.
34. Екстраверсія як властивість особистості ризик-менеджера.
35. Організація ризик-менеджменту на підприємстві.
36. Інтуїція в роботі ризик-менеджера.
37. Інсайт в роботі ризик-менеджера.
38. Евристика в роботі ризик-менеджера.
39. Ризик банкрутства.
40. Аналіз і рішення задач за допомогою дерева рішень.
41. Етапи управління ризиком.
42. Загальна характеристика інформації, необхідної для управління ризиком.
43. Ідентифікація та аналіз ризиків.
44. Як підбираються місяці ф'ючерсних контрактів для хеджувальних стратегій?
45. Які існують варіанти і їх ефективність для страхування цінних ризиків на ринку аграрної продукції?

Зразки тестових завдань для визначення рівня засвоєння знань

PhD студентами.

1. Які фактори ризиків в аграрній сфері ви можете назвати:
А) відсутність довготривалих орієнтирів
Б) відсутність адекватних економічних очікувань
В) незначна державна підтримка аграрного сектору
Г) вірні відповіді А, Б, В
2. Для оцінки ризиків в аграрній сфері рекомендується використовувати:
А) шкалу регресії
Б) аналіз сценаріїв
В) матрицю результатів
Г) вірні відповіді А і Б
3. Керування ризиками в аграрній сфері рекомендується використовувати:
А) спеціалізація виробництва
Б) кооперація
В) сільськогосподарське страхування
Г) вірні відповіді А, Б, В
4. Джерелом фінансового ризику в агропромисловому комплексі є:
А) зростання позикового капіталу
Б) непередбачене рух грошових коштів
В) вірні відповіді А і Б

5. Рекомендована схема оцінки ризику на підприємствах в агарній сфері передбачає:

- А) використання розрахунку профілю ризиків
- Б) застосування статистичних методів
- В) облік всіх зон господарювання

6. Модель поведінки базису наявної і ф'ючерсної цін, що виявляється в сходженні називається

- А) дивергенція
- Б) конвергенція
- В) коваріація
- Г) королівства

7. Суб'єкт управління у системі управління ризиком – це

- А) процес вироблення мети ризику, виявлення ступеня і величини ризику
- Б) спеціальна група людей, які за допомогою різних прийомів і способів управлінського впливу здійснюють зменшення ступеня ризику
- В) спеціальна група людей, які за допомогою різних прийомів і способів управлінського впливу здійснюють цілеспрямоване функціонування об'єкта управління
- Г) вірні відповіді А і В

8. Процедури управління ризиком у виробництві полягають в

- А) швидко прийняті рішення щодо скорочення рівня ризику
- Б) розробці та реалізації антиризикових заходів
- В) визначенні областей - джерел виробничого ризику
- Г) вірні відповіді Б і В

9. Ключова роль у вирішенні проблем управління ризиком належить

- А) ризик-менеджеру
- Б) фахівцю в галузі аналізу та оцінки ризику (імовірнісних) ситуацій
- В) керівництву підприємства
- Г) вірні відповіді А і Б

10. В умовах агропродовольчого підприємства управління ризиком ґрунтується на

- А) концепції прийнятності ризику
- Б) концепції керуючих систем
- В) концепції оптимізації невизначеності і прибутку

8. Методи навчання

Методами навчання є способи спільної діяльності й спілкування викладача і здобувачів вищої освіти, що забезпечують вироблення позитивної мотивації навчання, оволодіння системою професійних знань, умінь і навичок, формування наукового світогляду, розвиток пізнавальних сил, культури розумової праці майбутніх фахівців.

Під час навчального процесу використовуються наступні методи навчання:

Залежно від джерела знань: словесні (пояснення, бесіда, дискусія, діалог); наочні (демонстрація, ілюстрація); практичні (рішення задач, ділові ігри).

За характером пізнавальної діяльності: пояснювально-наочний проблемний виклад; частково-пошуковий та дослідницький методи.

За місцем в навчальній діяльності:

- методи організації й здійснення навчальної діяльності, що поєднують словесні, наочні і практичні методи; репродуктивні й проблемно-пошукові; методи навчальної роботи під керівництвом викладача й методи самостійної роботи здобувачів вищої освіти;

- методи контролю й самоконтролю за навчальною діяльністю: методи усного, письмового контролю; індивідуального й фронтального, тематичного і систематичного контролю.

У процесі викладання навчальної дисципліни для активізації навчально-пізнавальної діяльності

здобувачів вищої освіти передбачено застосування таких навчальних технологій:

- *робота в малих групах* дає змогу структурувати практично-семінарські заняття за формою і змістом, створює можливості для участі кожного здобувача вищої освіти в роботі за темою заняття, забезпечує формування особистісних якостей та досвіду соціального спілкування;

- *семінари-дискусії* передбачають обмін думками і поглядами учасників з приводу даної теми, а також розвивають мислення, допомагають формувати погляди і переконання, вміння формулювати думки й висловлювати їх, вчать оцінювати пропозиції інших людей, критично підходити до власних поглядів;

- *мозкові атаки* – метод розв’язання невідкладних завдань, сутність якого полягає в тому, щоб висловити як найбільшу кількість ідей за обмежений проміжок часу, обговорити і здійснити їх селекцію;

- *кейс-метод* – метод аналізу конкретних ситуацій, який дає змогу наблизити процес навчання до реальної практичної діяльності фахівців і передбачає розгляд виробничих, управлінських та інших ситуацій, складних конфліктних випадків, проблемних ситуацій, інцидентів у процесі вивчення навчального матеріалу;

- *презентації* – виступи перед аудиторією, що використовуються для подання певних досягнень, результатів роботи групи, звіту про виконання індивідуальних завдань, інструктажу, демонстрації.

9. Форми контролю

Відповідно до «Положення про екзамени та заліки у здобувачів вищої освіти ступеня доктор філософії в Національному університеті біоресурсів і природокористування України» затвердженого вченою радою НУБіП України 24 травня 2017 року, протокол № 11 із внесеними змінами Вченою радою НУБіП України 29 травня 2020 р., протокол №10, видами контролю знань здобувачів вищої освіти ступеня доктор філософії є поточний контроль, проміжна та підсумкова атестації.

Поточний контроль здійснюється під час проведення практичних, лабораторних та семінарських занять і має на меті перевірку рівня підготовленості здобувачів вищої освіти до виконання конкретної роботи.

Проміжна атестація проводиться після вивчення програмного матеріалу і має визначити рівень знань здобувачів вищої освіти з програмного матеріалу, отриманих під час усіх видів занять і самостійної роботи.

Форми та методи проведення проміжної атестації, засвоєння програмного матеріалу розробляються лектором дисципліни і затверджується відповідною кафедрою у вигляді тестування, письмової контрольної роботи, що можна оцінити чисельно.

Засвоєння здобувачем вищої освіти програмного матеріалу вважається успішним, якщо рейтингова оцінка його становить не менше, ніж 60 балів за 100-бальною шкалою.

Семестрова атестація проводиться у формах семестрового екзамєну або семестрового заліку з конкретної навчальної дисципліни.

Семестровий екзамєн - це форма підсумкової атестації засвоєння здобувачем вищої освіти теоретичного та практичного матеріалу з навчальної дисципліни за семестр.

Семестровий залік - це форма підсумкового контролю, що полягає в оцінці засвоєння аспірантом теоретичного та практичного матеріалу (виконаних ним певних видів робіт на практичних, семінарських або лабораторних заняттях та під час самостійної роботи) з навчальної дисципліни за семестр.

Диференційований залік - це форма контролю, що дозволяє оцінити виконання та засвоєння аспірантом програми навчальної дисципліни, педагогічної практики.

Аспіранти зобов’язані складати екзамени і заліки відповідно до вимог навчального плану у терміни, передбачені графіком освітнього процесу.

Зміст екзамєнів і заліків визначається робочими програмами дисциплін.

10. Розподіл балів, які отримують здобувачі.

Оцінювання знань здобувачів вищої освіти відбувається за 100-бальною шкалою і переводиться в національні оцінки згідно з табл. 1 «Положення про екзамени та заліки у здобувачів вищої освіти ступеня доктор філософії в Національному університеті біоресурсів і природокористування України», затвердженого Вченою радою НУБіП України від 24.05.2017 р., протокол №11 із внесеними змінами Вченою радою НУБіП України від 29 травня 2020 р., протокол №10.

Таблиця 1. Співвідношення між рейтингом здобувача вищої освіти і національними оцінками

Рейтинг аспіранта, бали	Оцінка національна за результати складання	
	екзаменів	заліків
90-100	відмінно	зараховано
74-89	добре	зараховано
60-73	задовільно	зараховано
0-59	незадовільно	незараховано

Для визначення рейтингу здобувача вищої освіти із засвоєння дисципліни $R_{\text{дис}}$ (до 100 балів) одержаний рейтинг з атестації (до 30 балів) додається до рейтингу з навчальної роботи $R_{\text{НР}}$ (до 70 балів):

$$R_{\text{дис}} = R_{\text{НР}} + R_{\text{АТ}}$$

Методичне забезпечення

1. Методичні вказівки щодо практичних занять з навчальної дисципліни «Управління ризиками, невизначеністю та складністю» для аспірантів денної та вечірньої форм навчання зі спеціальності 073 «Менеджмент» освітнього ступеня «Доктор філософії» / к. е. н., доц. Л. М. Хоменко – Кременчук, КНУ ім. М. Остроградського, 2018. – 41 с.
2. Грушина А.І. Методичні рекомендації щодо забезпечення самостійної роботи студентів з дисципліни «Ризик-менеджмент» (для бакалаврів). К. : МАУП, 2018. 17 с.

12. Рекомендована література

Базова

1. Резнік Н.П., Слободяник А.М., Благодатний А. С. Детермінанти розвитку біржового ринку агропродовольчої продукції в Україні: [монографія]. К.: Білоцерківдрук, 2019. 404 с.
2. Солодкий М.О., Яворська В.О. Хеджування ф'ючерсами і опціонами: навч. посіб. К.: Компрінт, 2018. 201 с.
3. Резнік Н.П., Слободяник А.М., Лещук Ю.А. Розвиток біржового ринку сільськогосподарської продукції в Україні [монографія]. К. : НУБіП, 2020. 238 с.
4. Резнік Н.П., Слободяник А.М., Самофалова М.О., Саковська О.М.. Ризик-менеджмент в АПК [монографія] К. : НУБіП, 2020. 291 с.
5. Резнік Н.П., Слободяник А.М., Самофалова, Саковська О.М.. Управління фінансовою санацією і банкрутством: навчальний. посібник. К.: НУБіП, 2020. 446 с.
6. Антикризисное управление: Учебник. / Под ред. Э.М. Короткова. М.:ИНФРА, 2001. 432 с.
7. Борисова В.А. Відтворення природного потенціалу АПК: економічні аспекти. Суми: Вид-во «Довкілля», 2013. 372 с.
8. Інвестиційне забезпечення конкурентоспроможності агропромислових формувань: [монографія] / за ред. Резнік Н.П. К.: Білоцерківдрук, 2018. 380 с.
9. Управління розвитком підприємницьких структур аграрного сектору: [монографія] / за ред. Резнік Н.П. К. : Білоцерківдрук, 2018. 404 с.
10. Єріна А.М. Статистичне моделювання та прогнозування: навч. посіб. Електронний ресурс. URL: <http://studentam.kiev.ua/content/view/774/82/>
11. Вербіцька І.І. Ризик-менеджмент як сучасна система управління ризиками підприємницьких структур. Сталий розвиток економіки. Міжнародний науково-виробничий журнал. 2013. № 5 (22). С. 282–291
12. Дуднєва Ю.Е. Проблеми та перспективи впровадження стандартів ризик-менеджменту в Україні. Вісник Нац. техн. ун-ту «ХПІ»: зб. наук. пр. темат. вип. : Актуальні проблеми управління та фінансово-господарської діяльності підприємства. 2014. № 4

(1047). С. 67–74.

13. Іванюта Т. М. Економічна безпека підприємства: навч. посіб. [для студ. вищ. навч. закл.] К.: Центр учбової літератури, 2009. 256 с.
14. Резнік Н.П., Ярмолюк А.В. Прогнозування поведінки біржового ф'ючерсного ринку сільськогосподарської продукції. Український журнал прикладної економіки. 2020. Том 5. № 3. С. 233 – 242. ISSN 2415- 8453.
15. Резнік Н.П., Костилян В.А. Антикризове управління підприємством, як засіб захисту підприємства від банкрутства. Вісник ХНАУ. Серія «Економічні науки». 2019. Випуск №4 Том. 1/2. С. 213-223. http://visen.knau.kharkov.ua/201941_22.html.
16. Резнік Н.П., Подолянюк І.П. Теоретичні та методичні основи ключових показників діяльності сільськогосподарського підприємства. Всеукраїнський науковий журнал «Актуальні проблеми інноваційної економіки. Серія «Економічні науки». 2019. Випуск №4. С. 33-38.
17. Резнік Н.П., Сиза Н. Теоретичні основи формування інтегрованої системи менеджменту на агропромислових підприємствах. Український журнал прикладної економіки 2020. № 1. С. 27 – 33. ISSN 2415-8453. http://apie.org.ua/wp-content/uploads/2020/11/apie_2020_r01_a05.pdf
18. Фінансовий менеджмент: Навч. посіб. / За ред. Проф. Г.Г. Кірейцева. К.: ЦУЛ, 2002. 496 с.

Допоміжна

1. Технический анализ. URL:<http://www.markets.com/ru/education/technicalanalysis/>
2. Основа технического анализа. URL:<http://berg.com.ua/tech/technicalanalysis-in-detail/>
3. John Hull. Options, Futures and Other Derivative Securities. 9-edition- New Jersey, University of Toronto, Prentice Hall, Englewood Cliffs, 2015. 852p.
4. Лактіонов О.В. Біржові стратегії управління цінним ризиком. НАН України; Північно- Східний науковий центр; Харківський держ. технічний ун-т будівництва та архітектури. Кафедра біржової, страхової та банківської справи. Препр. доповіді ПСНЦ НАН України, ХДТУБА .Х.: ПСНЦ НАН України, 2000. 24с.
5. Савощенко А.С. Інфраструктура товарного ринку: навч. посібн. К. : КНЕУ. 2005. 336 с.
6. Бланк И. А. Финансовый менеджмент: учебный курс. К.: Ника- Центр, Эльга, 2004.

13. Інформаційні ресурси

1. <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/436-15>
2. <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/2755-17>
3. <http://www.ukrstat.gov.ua/>
4. <https://kmbs.ua/ua/edp/finance/biznes-analitika>
5. <https://youcontrol.com.ua/ru/>
6. <https://data.gov.ua/>
7. https://minjust.gov.ua/open_data
8. <https://smartfarming.ua/ua-blog/otkrytye-dannye--resurs-dlya-povysheniya-effektivnosti-selskogo-hozyajstva>
9. https://nais.gov.ua/pass_opendata
10. Електронні та друковані видання бібліотеки ім. Вернадського
www.nbu.gov.ua
11. Аналітичне видання. Журнал Інтернет-трейдинг (Бібліотека кафедри біржової діяльності)
12. Аналітичне видання. Журнал Біржовий моніторинг (бібліотека кафедри біржової діяльності)
13. Financial Derivatives: Definition, Types, Risks - The Balance. URL:

<https://www.thebalance.com>.

14. Financial Derivatives- IMF URL:

<https://www.imf.org/external/bopage/pdf/98-1-20.pdf>

15. Financial derivatives. Concepts. Statistics URL:

https://www.stat.fi/meta/kas/johdannaiset_en.html

16. International Organization for Standardization URL: <https://www.iso.org>