

**НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ БІОРЕСУРСІВ І
ПРИРОДОКОРИСТУВАННЯ УКРАЇНИ**

Кафедра фінансів

“ЗАТВЕРДЖУЮ”

Декан економічного факультету

Анатолій ДІБРОВА

Протокол № 11 від “16” травня 2024 р.

“СХВАЛЕНО”

на засіданні кафедри фінансів

Протокол № 13 від “16” травня 2024 р.

Завідувач кафедри

Наталія ШВЕЦЬ

”РОЗГЛЯНУТО”

Гарант ОП «Корпоративні фінанси»

Лариса ОЛІЙНИК

**РОБОЧА ПРОГРАМА
НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ
ФІНАНСОВІ РИЗИКИ КОРПОРАЦІЙ**

Галузь знань 07 «Управління та адміністрування»

Спеціальність 072 «Фінанси, банківська справа та страхування»

Освітня програма «Корпоративні фінанси»

Факультет (ННІ) Економічний

Розробник: доцент кафедри фінансів, к.е.н., доцент Стороженко О.О.

Київ – 2024 р.

Опис навчальної дисципліни Фінансові ризики корпорацій

(назва)

Галузь знань, спеціальність, освітня програма, освітній ступінь		
Освітній ступінь	<i>Бакалавр</i>	
Спеціальність	<i>072 «Фінанси, банківська справа та страхування»</i>	
Освітня програма	<i>Корпоративні фінанси</i>	
Характеристика навчальної дисципліни		
Вид	обов'язкова	
Загальна кількість годин	150	
Кількість кредитів ECTS	5	
Кількість змістових модулів	2	
Курсовий проект (робота) (за наявності)	-	
Форма контролю	<i>екзамен</i>	
Показники навчальної дисципліни для денної та заочної форм здобуття вищої освіти		
	Денна форма здобуття вищої освіти	Заочна форма здобуття вищої освіти
Курс (рік підготовки)	4	-
Семестр	8	-
Лекційні заняття	<i>30 год.</i>	<i>- год.</i>
Практичні, семінарські заняття	<i>30 год.</i>	<i>- год.</i>
Лабораторні заняття	<i>- год.</i>	<i>- год.</i>
Самостійна робота	<i>90 год.</i>	<i>- год.</i>
Кількість тижневих аудиторних годин для денної форми здобуття вищої освіти	<i>4 год.</i>	<i>- год.</i>

1. Мета, завдання, компетентності та програмні результати навчальної дисципліни

Метою викладання даної навчальної дисципліни є формування у студентів компетентностей щодо використання системи знань з управління фінансами корпорацій, визначення стратегії і тактики фінансового забезпечення корпорацій, набуття необхідної сукупності теоретичних і практичних знань, вмінь та навичок для використання технологій та інструментарію фінансового управління корпораціями.

Для досягнення мети поставлені такі **основні завдання**:

- дослідити теоретичні основи організації фінансів корпорацій та реалізації фінансового менеджменту;
- оволодіти вмінням використання знань щодо основ організації фінансів корпорацій та реалізації фінансового менеджменту в умовах практичної діяльності або у процесі навчання для ефективного формування, розподілення та управління фінансовими ресурсами корпорацій на основі результатів аналізу та планування з метою формування оптимальних стратегічних і тактичних напрямів їх функціонування;
- провести аналіз взаємозв'язків структурних елементів системи забезпечення фінансового менеджменту та оволодіти вмінням використання їх практичної демонстрації для прийняття оптимальних фінансових рішень щодо визначення активів та джерел фінансування з метою забезпечення необхідного фінансового стану корпорацій.

Набуття компетентностей:

інтегральна компетентність (ІК): здатність розв'язувати складні спеціалізовані завдання та практичні проблеми у галузі фінансів, банківської справи та страхування в ході професійної діяльності або у процесі навчання, що передбачає застосування окремих методів і положень фінансової науки та характеризується невизначеністю умов і необхідністю врахування комплексу вимог здійснення професійної та навчальної діяльності.

загальні компетентності (ЗК):

ЗК02. Здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях.

ЗК07. Здатність вчитися і оволодівати сучасними знаннями.

спеціальні (фахові) компетентності (СК):

СК03. Здатність до діагностики стану фінансових систем (державні фінанси, у тому числі бюджетна та податкова системи, фінанси суб'єктів господарювання, фінанси домогосподарств, фінансові ринки, банківська система та страхування);

СК12. Здатність формувати та приймати фахові рішення у сфері корпоративних фінансів суб'єктів господарювання аграрного сектору.

Програмні результати навчання (ПРН):

ПРН05. Володіти методичним інструментарієм діагностики стану фінансових систем (державні фінанси, у тому числі бюджетна та податкова системи, фінанси суб'єктів господарювання, фінанси домогосподарств, фінансові ринки, банківська система та страхування).

ПРН24. Знати і вміти застосовувати на практиці методи та інструменти ідентифікації та розв'язання проблем в сфері корпоративних фінансів.

2. Програма та структура навчальної дисципліни для:

- повного терміну денної (заочної) форми здобуття вищої освіти.

Структура навчальної дисципліни для:

- повного терміну денної (заочної) форми навчання;

Назви змістових модулів і тем	Кількість годин													
	дєнна форма							Заочна форма						
	тижні	усього	у тому числі					усього	у тому числі					
			л	п	лаб	інд	с.р.		л	п	лаб	інд	с.р.	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	
Змістовий модуль 1. Теоретичні основи поняття фінансового ризику														
Тема 1. Сутність і види фінансових ризиків корпорацій	1-2	16	3	3			10							
Тема 2. Основи оцінки фінансових ризиків	3-4	18	4	4			10							
Тема 3. Кредитний ризик	5-6	20	4	4			12							
Тема 4. Валютний ризик	7-8	21	4	4			13							
Разом за змістовим модулем 1		75	15	15			45							
Змістовий модуль 2. Види фінансових ризиків та фінансова безпека корпорацій														
Тема 5. Процентний ризик	9-10	18	4	4			10							
Тема 6. Ринковий ризик	11-12	20	4	4			12							
Тема 7. Соціальний ризик	13	16	3	3			10							
Тема 8. Фінансова безпека корпорацій	14-15	21	4	4			13							
Разом за змістовим модулем 2		75	15	15			45							
Усього годин		150	30	30			90							
Курсовий проект (робота) з _____			-	-	-		-		-	-	-		-	
(якщо є в робочому навчальному плані)														
Усього годин		150	30	30			90							

3. Теми практичних занять

№ з/п	Назва теми	Кількість годин
1	Сутність і види фінансових ризиків корпорацій	3
2	Основи оцінки фінансових ризиків	4
3	Кредитний ризик	4
4	Валютний ризик	4
5	Процентний ризик	4
6	Ринковий ризик	4
7	Соціальний ризик	3
8	Фінансова безпека корпорацій	4
	Разом	30

4. Самостійна робота

№ з/п	Зміст виконаної роботи	Кількість годин
1	Розглянути теоретичні основи та принципи фінансових ризиків	10
2	Розкрити місце та значення фінансових ризиків корпорацій в економіці країни	10
3	Проаналізувати необхідну фінансову інформацію, розрахувати показники, що характеризують стан кредитного ризику.	12
4	Проаналізувати основні складові валютного ризику та розглянути фактори впливу (внутрішні та зовнішні)	13
5	Проаналізувати основні складові валютного ризику та розглянути фактори впливу (внутрішні та зовнішні)	10
6	Проаналізувати основні складові процентного ризику та дати характеристику сучасного стану банківської системи країни	12
7	Проаналізувати вплив соціального ризику на життєдіяльність корпорацій та формування стратегій розвитку країни в цілому	10
8	Охарактеризувати основні засади фінансової безпеки корпорацій. Знайти приклади вдалого вирішення концептуальних проблем ризиків в міжнародній практиці	13
	Разом	90

5. Засоби діагностики результатів навчання:

- модульні тести;

- реферати;
- розрахункові роботи;
- інші види.

6. Методи навчання

- словесний метод (лекція, дискусія, співбесіда тощо);
- наочний метод (метод ілюстрацій, метод демонстрацій);
- робота з навчально-методичною літературою (тезування, анотування, рецензування, складання реферату чи доповіді);
- відео метод (дистанційний, мультимедійний, веб-орієнтований тощо);
- самостійна робота (виконання завдання);
- індивідуальна науково-дослідна робота здобувачів вищої освіти;
- інші види.

7. Методи оцінювання

- екзамен;
- усне або письмове опитування;
- модульне тестування;
- реферати, есе;
- презентації;
- інші види.

8. Розподіл балів, які отримують здобувачі вищої освіти

Оцінювання знань здобувача відбувається за 100-бальною шкалою і переводиться в національні оцінки згідно з табл.1 чинного «Положення про екзамени та заліки у НУБіП України».

Рейтинг здобувача вищої освіти	Оцінка національна за результати складання	
	екзаменів	заліків
90-100	Відмінно	Зараховано
74-89	Добре	
60-73	Задовільно	
0-59	Незадовільно	Не зараховано

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): $R_{\text{дис}} = R_{\text{нр}} + R_{\text{ат}}$.

9. Навчально-методичне забезпечення

- електронний навчальний курс навчальної дисципліни (на навчальному порталі НУБіП України eLearn - <https://elearn.nubip.edu.ua/course/view.php?id=4697>);
- *Фінансові ризики корпорацій: методичні матеріали для вивчення дисципліни для здобувачів вищої освіти денної форми навчання освітнього ступеня «бакалавр» зі спеціальності 072 «Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок».* / Укл. О.О. Стороженко. Київ: НУБіП України. 2024.

10. Рекомендовані джерела інформації

1. Барановський О. І. Сутність і різновиди фінансових криз. *Фінанси України*. 2009. № 5. С. 3–20.
2. Вітлінський В. В., Великоіваненко Г. І. Ризикологія в економіці та підприємстві: монографія. Київ: КНЕУ, 2004. 460 с.
3. Гусак Д. В. Збірник задач з теорії випадкових процесів та її застосувань у фінансовій математиці та теорії ризику. Київський національний ун-т ім. Тараса Шевченка. Київ: ВПЦ «Київський ун-т», 2018. 287 с.
4. Гусак Д. В. Збірник задач з теорії випадкових процесів та її застосувань у фінансовій математиці та теорії ризику. Київський національний ун-т ім. Тараса Шевченка. Київ: ВПЦ «Київський ун-т», 2018. 287 с.
5. Закон України «Про внесення змін до деяких законодавчих актів України щодо спрощення залучення інвестицій та запровадження нових фінансових інструментів» від 19.06.2020 р.
6. Закон України «Про валюту і валютні операції» №2473-VIII від 21.06.2018 р.
7. Клапків М. С. Страхування фінансових ризиків: монографія. Тернопіль: Економічна думка, Карт-бланш, 2012. 570 с.
8. Красавіна Л.Н. Проблеми запобігання кризи на фінансовому ринку. Київ: Фінанси і кредит, 2018. 184 с.
9. Лактіонова О. А. Буферизація фінансової стабільності на основі формування механізму макропруденційного регулювання. *Економіка, організація, управління*. 2016. С. 127–142.
10. Матеріали семінару НБУ «Впровадження вимог Положення про організацію системи управління ризиками в банках України та банківських групах (для банків)». URL: https://old.bank.gov.ua/control/uk/publish/article?art_id=79051024&cat_id=77863483
11. Методичні рекомендації з управління ризиками в платіжних системах, 2020. URL: <https://bank.gov.ua/ua/news/all/metodichni-rekomendatsiyi-z-upravlinnya-rizikami-v-platijnih-sistemah>

Інформаційні ресурси

1. Сайт Світового валютного фонду. URL: <http://www.imf.org>;
2. Базельський комітет із банківського нагляду (Basel Committee on Banking Supervision). URL: <http://www.bis.org>;
3. Сайт Державної комісії з цінних паперів та фондового ринку. URL: <http://www.ssmc.gov.ua>;

4. Сайт Світової федерації фондових бірж. URL: <http://www.ssmc.gov.ua>;
5. Сайт Національного банку України. URL: www.bank.gov.ua;
6. Сайт Першої фондової торгівельної системи. URL: www.pfts.com;
7. Сайт Державного комітету статистики України. URL: www.ukrstat.gov.ua;
8. Сайт Світового банку. URL: www.worldbank.org.
9. *Global Financial Stability Report (GFSR) ½ year issues*. URL: <https://www.imf.org/en/Publications/GFSR/Issues/2018/04/02/Global-Financial-Stability-Report-April-2018>
10. Essentials of Risk Measurement – FinanceTrain. URL: <http://financetrain.com>