



СИЛАБУС
НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ
«Управління фінансовими ризиками»

Рівень вищої освіти	Другий (магістерський)
Код і найменування спеціальності, тип і назва освітньої програми	072 Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок ОП Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок
Статус навчальної дисципліни	Вибіркова
Курс, семестр	1, 2
Трудові одиниці	120
Мова(и) викладання	державна
ННІ / факультет, кафедра	Обліку та фінансів Фінансів, банківської справи та страхування
Контактні дані розробника(ів)	Дроботя Яна Анатоліївна, к.е.н., доцент, доцент кафедри фінансів, банківської справи та страхування iana.drobotia@pdau.edu.ua 0532565003 https://www.pdau.edu.ua/people/drobotya-yana-anatoliyivna
Мета вивчення навчальної дисципліни	Мета вивчення навчальної дисципліни: формування системи знань про сучасні методи управління фінансовими ризиками, які адекватні ринковим умовам; створення базису для сприйняття фінансової філософії і фінансової культури цього виду управлінської діяльності.
Компетентності	<i>Загальні:</i> ЗК4. Вміння виявляти, ставити та вирішувати проблеми. ЗК5. Здатність приймати обґрунтовані рішення. <i>Спеціальні (фахові) (СК):</i> СК3. Здатність застосовувати управлінські навички у сфері фінансів, банківської справи, страхування та фондового ринку. СК7. Здатність до пошуку, використання та інтерпретації інформації, необхідної для вирішення професійних і наукових завдань в сфері фінансів, банківської справи та страхування, страхування та фондового ринку.
Результати навчання	ПР04. Відшукувати, обробляти, систематизувати та аналізувати інформацію, необхідну для вирішення професійних та наукових завдань в сфері фінансів, банківської справи, страхування та фондового ринку. ПР12. Обґрунтувати вибір варіантів управлінських рішень у сфері фінансів, банківської справи, страхування та фондового ринку та оцінювати їх ефективність з урахуванням цілей, наявних обмежень, законодавчих та етичних аспектів.
Методи навчання	Методи навчання: 1. Методи організації та здійснення навчально-пізнавальної діяльності: словесні методи (лекція, розповідь, пояснення); наочні методи (ілюстрування); практичні методи (вправи). 2. Методи стимулювання і мотивації навчально-пізнавальної діяльності: методи формування пізнавальних

інтересів (створення ситуації інтересу й новизни навчального матеріалу, метод пізнавальної гри, метод використання життєвого досвіду, навчальні дискусії для вирішення проблемної ситуації, метод відповідей на запитання і опитування думок здобувачів вищої освіти); методи стимулювання і мотивації обов'язку і відповідальності (роз'яснення мети навчальної дисципліни, висування вимог до вивчення дисципліни, заохочення і покарання, оперативний контроль, вказування на недоліки, зауваження). 3. Інноваційні та інтерактивні методи навчання: інтерактивні методи (дискусії, метод «Дерева рішень», метод «Мікрофон»); комп'ютерні, мультимедійні методи (використання мультимедійних презентацій). 4. Методи контролю і самоконтролю за ефективністю навчально-пізнавальної діяльності: методи усного контролю (опитування); методи письмового контролю (контрольна робота, самостійна робота); методи самоконтролю (самостійний пошук помилок, самооцінювання, самоаналіз).

Програма навчальної дисципліни

Тема 1. Теоретичні основи управління фінансовими ризиками
Тема 2. Сутність, цілі та функції управління фінансовими ризиками підприємства
Тема 3. Методичний інструментарій оцінки фінансових ризиків
Тема 4. Дослідження систематичних та несистематичних фінансових ризиків підприємства
Тема 5. Механізм нейтралізації фінансових ризиків підприємства
Тема 6. Управління фінансовим ризиком в операційній діяльності підприємства
Тема 7. Управління фінансовим ризиком в інвестиційній діяльності підприємства
Тема 8. Нейтралізація ризику банкрутства в процесі кризового фінансового розвитку підприємства

Стратегія оцінювання результатів навчання

Схема нарахування балів з навчальної дисципліни

Назва теми	Форми оцінювання результатів навчання здобувачів вищої освіти						Разом
	Опитування	Виконання вправ на практичних заняттях	Розв'язування тестів	Контрольна робота	Виконання завдань самостійної роботи (підготовка тез)	Виконання завдань самостійної роботи (гlossenарі)	
Тема 1. Теоретичні основи управління фінансовими ризиками	4	2	2	-	-	1	9
Тема 2. Сутність, цілі та функції управління фінансовими ризиками підприємства	4	2	2	-	-	1	9
Тема 3. Методичний інструментарій управління фінансовими ризиками	4	2	2	-	-	1	9
Тема 4. Дослідження систематичних та несистематичних фінансових ризиків підприємства	4	2	2	-	-	1	9
Тема 5. Механізм нейтралізації фінансових ризиків підприємства	4	2	2	-	-	1	9
Тема 6. Управління фінансовим ризиком в операційній діяльності підприємства	4	2	2	-	-	1	9
Тема 7. Управління фінансовим ризиком в інвестиційній діяльності підприємства	4	2	2	-	-	1	9
Тема 8. Нейтралізація ризику банкрутства в процесі кризового фінансового розвитку підприємства	4	2	2	-	-	1	9
Контрольна робота	-	-	-	20	-	-	20
Виконання завдань самостійної роботи (виступ з тезами)	-	-	-	-	8	-	8
Разом	32	16	16	20	8	8	100

Політика навчальної дисципліни

Відвідування занять є обов'язковим. Усі завдання, передбачені програмою, мають бути виконані у встановлений термін і в повній мірі. За використання телефонів і комп'ютерних засобів без дозволу викладача, порушення дисципліни здобувач вищої освіти

	<p>отримує на занятті 0 балів та зобов'язаний відпрацювати таке заняття.</p> <p>Якщо здобувач вищої освіти був відсутній на занятті, то він повинен відпрацювати пропущений матеріал та отримати за нього бали передбачені робочою програмою. Відпрацювати пропущені заняття здобувач повинен відповідно форми завдань, що були пропущені. У випадку якщо студент був відсутній на занятті або ж має індивідуальний графік навчання, то виконані завдання згідно встановлених строків потрібно надіслати викладачу або на корпоративну пошту або на платформу Moodle Письмові роботи перевіряються на наявність плагіату і допускаються до захисту із коректними текстовими запозиченнями у межах встановлених норм. У разі виявлення факту плагіату здобувач вищої освіти отримує за завдання 0 балів і повинен повторно виконати його. Списування під час контрольних робіт та екзаменів заборонені (у т. ч. із використанням мобільних пристроїв). Мобільні пристрої дозволяється використовувати лише під час он-лайн тестування.</p> <p>Документи стосовно академічної доброчесності наведені на сторінці АКАДЕМІЧНА ДОБРОЧЕСНІСТЬ ПДАУ: https://www.pdaa.edu.ua/content/akademichna-dobrochesnist.</p> <p>Є можливість визнання результатів навчання, набутих у неформальній / інформальній освіті якщо ці результати отримані перед опануванням даної освітньої компоненти. Набуття відповідних результатів навчання можливе після успішного опанування курсів (з документальним підтвердженням) на різноманітних навчальних платформах, зокрема: Prometheus, Coursera тощо. Особливості неформального / інформального навчання регламентовані Положенням про порядок визнання результатів навчання, набутих у неформальній та інформальній освіті, здобувачами вищої освіти Полтавського державного аграрного університету.</p>
<p>Передумови для вивчення навчальної дисципліни (за потреби)</p>	<p>Перелік дисциплін, які передують її вивченню відповідно до структурно-логічної схеми освітньо-професійної програми: «Фінансовий менеджмент».</p>
<p>Додаткові матеріали для представлення навчальної дисципліни (за потреби)</p>	<p>Презентації</p>
<p>Рекомендовані джерела інформації</p>	<p style="text-align: center;">Основні</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Дроботя Я. А. Управління фінансовими ризиками: навч. посіб. Полтава: ПДАА, 2019. 160 с. 2. Куцик П. О., Васильців Т. Г., Сороківський В. М., Стефаняк В. І., Сороківська М. В., Управління фінансовими ризиками: навч. посібник. Львів: Раст-7. 2016. 318 с. 3. Лактіонова О. А. Управління фінансовими ризиками: навчальний посібник. Вінниця: ДонНУ імені Василя Стуса, 2020. 256 с. 4. Ризик-менеджмент: навчальний посібник для здобувачів спец. 051 «Економіка» та 073 «Менеджмент» /З.Д. Калініченко . Дніпро: ДДУВС, 2021. 224 с. 5. Шклярук С. Г. Управління фінансовими ризиками: навч. посіб. Київ: Персонал, 2019. 494 с. <p style="text-align: center;">Допоміжні</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Бойко Л. М., Дроботя Я. А. Капітал та фінансові ризики пов'язані з ним. <i>Наукові праці Полтавської державної аграрної академії</i>. Вип. 2 (7). Т. 2. Полтава: ПДАА. 2013. С. 28–32.

2. Дроботя Я. А. Особливості систематичних та несистематичних ризиків сільськогосподарських підприємств. *Вісник Харківського національного аграрного університету імені В. В. Докучаєва. Серія «Економічні науки»*. Харків: ХНАУ. 2017. № 1. С. 51-57.
3. Дроботя Я. А. Особливості парадигми фінансових ризиків ТНК. *Глобальні та національні проблеми економіки*. Миколаїв: Миколаївський національний університет імені В. О. Сухомлинського. 2017. № 18. URL: <http://global-national.in.ua/archive/18-2017/86.pdf>
4. Дроботя Я. А. Нетрадиційні банківські послуги та фінансові ризики пов'язані з ними: реалії України, міжнародний досвід. *Вісник Харківського національного аграрного університету імені В. В. Докучаєва. Серія «Економічні науки»*. Харків: ХНАУ. 2018. № 1. С. 31-40.
5. Дроботя Я. А. Глобалізація та інтеграція: фінансові ризики і переваги від залучення іноземного банківського капіталу. *Глобальні та національні проблеми економіки*. Миколаїв: Миколаївський національний університет імені В. О. Сухомлинського. 2018. № 22. С. 789-793. URL: <http://global-national.in.ua/archive/22-2018.pdf>.
6. Дроботя Я. А. Управління матеріальними запасами з використанням теорії управління фінансовими ризиками. *Вісник Мукачівського державного університету «Економіка та суспільство»*. Мукачево. 2019. № 20. С. 627-634. URL: <http://economyandsociety.in.ua>.
7. Дроботя Я. А. Інвестиційні ризики в діяльності сучасних сільськогосподарських підприємств. *Науковий вісник Одеського національного університету імені І. І. Мечникова. Серія «Економіка»*. 2020. Том 25. Випуск 3(82). С. 109-113.
8. Дроботя Я. А., Собчишин В. М., Гаращенко В. О. Фінансовий ризик незбалансованої ліквідності: оцінка та управління. *Вісник ХНАУ. Серія «Економічні науки»*. 2020. № 1. С. 32-42.
9. Собчишин В. М., Дроботя Я. А. Управління фінансовою стійкістю підприємства: зміст, етапи та напрями. *Економіка. Фінанси. Менеджмент: актуальні питання науки і практики*. Вінниця. 2019. № 6 (46). С. 121-129.
10. Дроботя Я. А., Гаращенко В. О. Вплив ризику незбалансованої ліквідності на діяльність сільськогосподарського підприємства. *Фінанси, банківська система та страхування: стан, проблеми та перспективи розвитку в кризовій економіці України: збірник матеріалів міжнародної науково-практичної конференції (02-03 березня 2020 р.)*, ДДАЕУ. С. 9-10.
11. Дроботя Я. А., Краснікова О. М., Собчишин В. М. Місце фінансового ризику у фінансовій безпеці підприємства. *Міжнародна та національна безпека: теоретичні і прикладні аспекти: матеріали IV Міжнародної науково-практичної конференції (13 березня 2020 р.)*, Дніпро: Дніпроп. держ. ун-т внутр. справ. С. 145-147.
12. Дроботя Я. А. Фінансова звітність як індикатор фінансової безпеки підприємства. *Формування та перспективи розвитку підприємницьких структур в рамках інтеграції до європейського простору: матеріали III Міжнародної науково-практичної конференції (24 березня 2020 р.)*, Полтава. С. 82-84.
13. Дроботя Я. А. Управління фінансовими ризиками з використанням логістики як інновація підтримки конкурентоспроможності підприємства. *Управління проектами. Ефективне використання результатів наукових досліджень та об'єктів інтелектуальної власності: збірник наукових праць за матеріалами II міжнародної науково-практичної інтернет*

конференції (10 квітня 2020 р.). Дніпро: Юрсервіс. С. 227-229.

14. Дроботя Я. А. Управління інвестиційним ризиком з метою забезпечення фінансово-економічного потенціалу сільськогосподарського підприємства. *Актуальні проблеми використання економічного потенціалу: держава, регіон, підприємство*: матеріали ІХ всеукраїнської науково-практичної конференції студентів та молодих учених (16-17 квітня 2020 р.), Бердянськ: Талком. С. 87-90.

15. Дроботя Я. А. Управління оборотним капіталом: балансування між ліквідністю, прибутком, ризиком. *Модернізація економіки: сучасні реалії, прогностичні сценарії та перспективи розвитку*: матеріали ІІ міжнародної науково-практичної конференції (28 квітня 2020 р.), Херсон: Вишемирський В.С. С. 694-695.

16. Дроботя Я. А. Фінансові ризики банківської діяльності. *Наукове забезпечення розвитку національної економіки: досягнення теорії та проблеми практики*: матеріали VII Всеукраїнської науково-практичної конференції молодих вчених присвяченої 100-річчю з часу заснування Полтавської державної аграрної академії (29 жовтня 2020 р.), Полтава. С. 60-62.

17. Дроботя Я. А. Банківський бізнес в умовах цифрового суспільства. *Актуальні проблеми, пріоритетні напрямки та стратегії розвитку України*: матеріали І Міжнародної науково-практичної онлайн-конференції, м. Київ, (15 березня 2021 року), Київ. С. 138-139.

18. Дроботя Я. А. Роль фінансових ризиків в житті суспільства. *Збірник наукових праць науково-практичної конференції професорсько-викладацького складу Полтавської державної аграрної академії за підсумками науково-дослідної роботи в 2020 році*, м. Полтава, (14 травня 2021 р.), Полтава. С. 83-85.

19. Дроботя Я. А., Левченко Г. В. Кредитування аграріїв: ризики для банків. *Теоретичні та практичні засади забезпечення сталого агровиробництва та соціально-економічного розвитку сільських територій в умовах інноваційної економіки*: матеріали Всеукраїнської науково-практичної конференції, м. Полтава, (20 травня 2021 р.), Полтава. С.119-121.

20. Дроботя Я. А., Левченко Г. В. Управління банківськими ризиками. *Модернізація економіки: сучасні реалії, прогностичні сценарії та перспективи розвитку*: матеріали ІІІ Міжнародної науково-практичної конференції, м. Херсон, (28-29 квітня 2021 р.), Херсон. С. 406-408.

21. Дроботя Я. А., Дорошенко О. О., Зоря С. П. Фінансові ризики сучасного суспільства. *Бухгалтерський облік, контроль та аналіз в умовах інституційних змін*: матеріали Всеукраїнської науково-практичної конференції. м. Полтава (27 жовтня 2022 р.), Полтава: ПДАУ, С. 873-875. URL: <http://dspace.pdaa.edu.ua:8080/handle/123456789/13764>

22. Дроботя Я. А., Дорошенко О. О. Мінімізація фінансових ризиків під час здійснення кредитних операцій комерційного банку. *Трансформаційні зміни національної економіки в умовах євроінтеграції*: збірник тез VI Всеукраїнської науково-практичної конференції. м. Дубляни, (7-8 грудня 2022 року). Дубляни, 2022 С. 45-47. URL: <http://dspace.pdaa.edu.ua:8080/handle/123456789/13765>.

Інформаційні ресурси

1. Сайт Верховної Ради України: <http://zakon4.rada.gov.ua/laws>.
2. Сайт Національної бібліотеки України імені В. І. Вернадського: <http://www.nbuv.gov.ua/>.
3. Сайт державного комітету статистики України: <https://www.ukrstat.gov.ua/>

Рік введення

2023