

**Ризик менеджмент в аграрній сфері**  
**Кафедра менеджменту ім. проф. Й. С. Завадського**  
**Факультет аграрного менеджменту**

<i>Лектор</i>	Д.е.н., професор Резнік Н. П.
<i>Семестр</i>	3
<i>Освітній ступінь</i>	Доктор філософії
<i>Кількість кредитів ЄКТС</i>	5
<i>Форма контролю</i>	Екзамен
<i>Аудиторні години</i>	50 (20 год лекцій, 30 год практичних)

**Загальний опис дисципліни**

Предметом дисципліни «Ризик менеджмент в аграрній сфері» є теоретичні та практичні питання системного аналізу економічного ризику, математичні методи та моделювання економічних систем, обтяжених ризиком в аграрній сфері.

Головною метою вивчення дисципліни «Ризик менеджмент в аграрній сфері» – полягає в отриманні здобувачами ступеня доктора філософії теоретичних знань і практичних знань в галузі оцінки та управління ризиком на підприємствах аграрної сфери, що сприяє розвитку у них навичок комплексної оцінки і діагностики ефективності підприємства в цілому.

Актуальність дисципліни обумовлена тим, що ризик у підприємницькій діяльності природно поєднується з менеджментом, з усіма його функціями – плануванням, організацією, оперативним управлінням, використанням персоналу, економічним контролем. Кожна з цих функцій пов'язана з певним ступенем ризику і вимагає створення адаптивної до нього системи господарювання. Вивчення та облік невизначеності, конфліктності, багатокритеріальності й пов'язаного з ними ризику є важливим напрямом сучасної економічної теорії. Об'єкт управління ситуацією характеризується багатоваріантністю розвитку та можливістю виникнення непередбачених ситуацій. Таким чином, основними характеристиками сучасного керівника є уміння працювати в умовах невизначеності, робити раціональний вибір із безлічі можливих альтернатив.

Основними компетентностями, якими повинен володіти здобувач ступеня доктора філософії під час вивчення дисципліни є:

- здатність до логічних висновків, абстрактного мислення, аналізу та синтезу;
- здатність до аналізу наукових надбань в сфері досліджень ризиків, що виникають а процесі управління аграрним підприємством;
- здатність до креативного мислення для формулювання ефективних рішень щодо вибору протиризованих заходів;
- здатність до прийняття ефективних рішень, які мають економіко-математичне обґрунтування;
- комплексність у володінні інформацією щодо стану підприємства та особливостей планування послідовності дій по управлінню ризиками;
- комплексність у розробці та особливостях застосування інструментів хеджування ризиків в аграрній сфері;

**Теми лекцій:**

**ТЕМА 1. 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.

**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.

**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.

**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. 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 в страхуванні ризиків. Ризик сторони по угоді. Ризик процентної ставки. Ціновий ризик. Ризик ліквідності. Системний ризик.

**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.

**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.

**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.

**Теми практичних занять:**

ТЕМА 1. Основні аспекти та тенденції ризик-менеджменту. Класифікація ризиків.

ТЕМА 2. Аналіз і оцінка ступенів ризику.

ТЕМА 3. Управління ризиками, як система менеджменту.

ТЕМА 4. Галузеве управління ризиками.

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

ТЕМА 6. Ф'ючерсна торгівля на ринках АПК.

ТЕМА 7. Основні стратегії хеджування на ринку агропродовольчої продукції.

ТЕМА 8. Хеджування опціонами на агропродовольчу продукцію.