Білоцерківський національний аграрний університет
Економічний факультет
Кафедра фінансів, банківської справи та страхування

	СИЛАБУС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ **«УПРАВЛІННЯ ФІНАНСОВИМИ РИЗИКАМИ»** Галузь знань – 07 «Управління та адміністрування» Спеціальність – 072 «Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок» Освітня програма – «Фінанси, банківська справа та страхування»
Рівень вищої освіти	другий (магістерський)
Компонент освітньої програми:	вибірковий
Кількість кредитів ECTS / загальна кількість годин	3 кредити /90 годин
Семестр	3
Форма контролю	Залік
Мова викладання	українська
Профайл викладача	**Драган Оксана Олександрівна** **Посада: доцент кафедри фінансів, банківської справи та страхування** **Науковий ступінь:** кандидат економічних наук **Робоче місце:** навчальний корпус № 3 (пл. Соборна, 8/1), 130 ауд. (кафедра фінансів, банківської справи та страхування). **E-mail: okdragan@btsau.edu.ua** **Зв'язок з викладачем:** відповідно до графіку консультацій; +380987720608
Опис дисципліни	Навчальна дисципліна «Управління фінансовими ризиками» є невід'ємною складовою комплексної підготовки фахівців спеціальності «Фінанси, банківська справа та страхування». Вивчення курсу «Управління фінансовими ризиками» дозволить дізнатися, які фінансові ризики найбільш актуальні, як їх можна оцінити і виміряти і які підходи (методи) слід використовувати для зниження ймовірності їх виникнення та зменшення збитків які виникають після їх реалізації.
Передумови для вивчення дисципліни	Вибіркова навчальна дисципліна «Управління фінансовими ризиками» базується на знаннях отриманих з таких навчальних дисциплін, як «Фінанси», «Гроші і кредит», «Страхування», «Інвестування», «Фінанси підприємств» тощо.
Мета вивчення дисципліни	Метою навчальної дисципліни «Управління

	фінансовими ризиками» є послідовне формування у здобувачів знань основних положень теорії і практики ризик-менеджменту в сфері фінансових взаємовідносин суб'єктів господарської діяльності та формування у них системного уявлення про дисципліну, що читається та вироблення навичок прийняття рішень з проблем виявлення та ідентифікації ризиків, способи їх виявлення та мінімізації, що застосовуються на фінансових ринках як національного, так і міжнародного рівнів.
Формат дисципліни	Для денної форми навчання дисципліна викладається в очному форматі, із застосуванням мультимедійних засобів. За необхідності (індивідуальні графіки, дистанційна тощо) можуть використані платформи Moodle, ZOOM. Формат проведення дисципліни є змішаним: поєднання традиційних форм навчання з елементами дистанційного навчання.
Очікувані результати навчання	1. Здійснювати адаптацію та модифікацію існуючих наукових підходів і методів до конкретних ситуацій професійної діяльності. 2. Відшуковувати, обробляти, систематизувати та аналізувати інформацію, необхідну для вирішення професійних та наукових завдань в сфері фінансів, банківської справи та страхування. 3. Здійснювати діагностику і моделювання фінансової діяльності суб'єктів господарювання. 4. Обґрунтувати вибір варіантів управлінських рішень у сфері фінансів, банківської справи та страхування та оцінювати їх ефективність з урахуванням цілей, наявних обмежень, законодавчих та етичних аспектів.
Структура курсу	*Змістовий модуль 1.* **Теоретико-методичні засади управління фінансовими ризиками** Тема 1. Теоретичні основи управління фінансовими ризиками. Тема 2. Політико-економічний ризик у системі ризик-менеджменту. Тема 3. Хеджування фінансових ризиків на ринку строкових угод. Тема 4. Інтеграція страхових організацій та комерційних банків у сфері ризик-менеджменту. *Змістовий модуль 2.* **Види фінансових ризиків, методи їх аналізу та оцінки** Тема 5. Управління інвестиційними ризиками. Тема 6. Ризик неплатоспроможності суб'єктів господарювання. Тема 7. Кредитний ризик в системі фінансових відносин. Тема 8. Управління фінансовими ризиками на

	іпотечному ринку. Тема 9. Особливості управління фінансовими ризиками в банківській діяльності. Тема 10. Відсотковий ризик, методи аналізу та управління. Тема 11. Галузеве управління ризиками.
Методи навчання	Під час викладання курсу використовуються наступні методи навчання: розповідь – для оповідної, описової форми розкриття навчального матеріалу; пояснення – для розкриття сутності певного явища, закону, процесу; бесіда – для усвідомлення за допомогою діалогу нових явищ, понять; практична робота – для використання набутих знань у розв'язанні практичних завдань; аналітичний метод – мисленнєвого або практичного розкладу цілого на частини з метою вивчення їх суттєвих ознак; індуктивний метод – для вивчення явищ від одиничного до загального;дедуктивний метод – для вивчення навчального матеріалу від загального до окремого, одиничного; проблемний виклад матеріалу – для створення проблемної ситуації.
Політика	**Політика щодо академічної доброчесності:** очікується, що письмові роботи здобувачів будуть їх оригінальними дослідженнями, розрахунками чи міркуваннями. Виявлення ознак академічної недоброчесності в письмовій роботі здобувача (списування, відсутність посилань на використані джерела, фабрикація, фальсифікація, обман) є підставою для її незарахування викладачем. **Політика щодо відвідування занять:** очікується, що здобувачі відвідають усі лекції і практичні заняття курсу. Здобувачі мають інформувати викладача про неможливість відвідати заняття. Відпрацювання пропущених занять згідно графіку консультацій викладача. За об'єктивних причин навчання може відбуватись в он-лайн режимі. **Політика щодо дедлайнів і перескладання**: здобувачі мають дотримуватися термінів виконання усіх видів робіт. **Політика щодо виконання завдань**: позитивно оцінюється відповідальність, старанність, креативність. **Політика оцінювання:** засоби та критерії оцінювання прописані в робочій програмі дисципліни, розміщеної на платформі Е-навчання Білоцерківського НАУ (Moodle).
Рекомендовані джерела інформації	**Базова література** 1. Бальбанов И.Т. Риск-менеджмент / И.Т. Бальбанов. – М.: Финансы и статистика, 2016. – 186 с. 2. Бездітко, О. (2020) «Управління фінансовими ризиками підприємства», Таврійський науковий вісник. Серія: Економіка, (3), с. 43-49. doi:

10.32851/2708-0366/2020.3.6.
3. Васильчишин О. Б. Фінансова безпека банківської системи України: філософські детермінанти: монографія. Тернопіль: ТНЕУ, 2017. 358 с. ISBN 978-966-654-484-4
4. Камінський А.Б. Економічний ризик та методи його вимірювання : посіб. для студ. екон. спец. вищ. навч. закл. / А. Б. Камінський. – К. : ІМФ при Київ. нац. ун-ті ім. Т. Шевченка, 2017.
5. Кузнєцова Н. В. Фінансовий ризик-менеджмент з урахуванням інформаційних ризиків. Реєстрація, зберігання і обробка даних. 2018. Т.20. №1. С. 30–39.
6. Financial institutions management: a riskmanagement approach / Anthony Saunders, BentleyUniversity , NinthEdition. | Dubuque: McGraw-Hill Education, 2017. URL: http://www.bulentsenver.com/FIN5477/Financial_Institutions_Management_AntonySaunders_TextBook.pdf
7. Transforming risk efficiency and effectiveness, 2019. URL: https://www.mckinsey.com/business-functions/risk/our-insights/transforming-risk-efficiency-and-effectiveness
8. Tarasevych, N. (2020). Actual Aspects of Risk Management System in Banks of Ukraine. Modern Economics, 21(2020), 213-218. DOI: https://doi.org/10.31521/modecon.V21(2020)-33.