

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

	<p style="text-align: center;"><b>СИЛАБУС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ</b></p> <p style="text-align: center;"><b>«УПРАВЛІННЯ ФІНАНСОВИМИ РИЗИКАМИ»</b></p> <p>Галузь знань – 07 «Управління та адміністрування»          Спеціальність – 072 «Фінанси, банківська справа та страхування»          Освітня програма – «Фінанси, банківська справа та страхування»</p>
<b>Рівень вищої освіти</b>	другий (магістерський)
<b>Компонент освітньої програми:</b>	вибірковий
<b>Кількість кредитів ECTS / загальна кількість годин</b>	3 кредити /90 годин
<b>Семестр</b>	3
<b>Форма контролю</b>	Залік
<b>Мова викладання</b>	українська
<b>Профайл викладача</b> 	<p><b>Драган Оксана Олександрівна</b>  <b>Посада:</b> доцент кафедри фінансів, банківської справи та страхування  <b>Науковий ступінь:</b> кандидат економічних наук  <b>Робоче місце:</b> навчальний корпус № 3 (пл. Соборна, 8/1), 130 ауд. (кафедра фінансів, банківської справи та страхування).  <b>E-mail:</b> okdragan@btsau.edu.ua  <b>Зв'язок з викладачем:</b> відповідно до графіку консультацій;                  +380987720608</p>
<b>Опис дисципліни</b>	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.
<b>Передумови для вивчення дисципліни</b>	Вибіркова навчальна дисципліна «Управління фінансовими ризиками» базується на знаннях отриманих з таких навчальних дисциплін, як «Фінанси», «Гроші і кредит», «Страхування», «Інвестування», «Фінанси підприємств», «Теорія ймовірності» тощо.

<p><b>Мета вивчення дисципліни</b></p>	<p>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.</p>
<p><b>Формат дисципліни</b></p>	<p>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.</p>
<p><b>Очікувані результати навчання</b></p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Здійснювати адаптацію та модифікацію існуючих наукових підходів і методів до конкретних ситуацій професійної діяльності.</li> <li>2. Відшукувати, обробляти, систематизувати та аналізувати інформацію, необхідну для вирішення професійних та наукових завдань в сфері фінансів, банківської справи та страхування.</li> <li>3. Здійснювати діагностику і моделювання фінансової діяльності суб'єктів господарювання.</li> <li>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.</li> </ol>
<p><b>Структура курсу</b></p>	<p style="text-align: center;"><i>Змістовий модуль 1.</i></p> <p><b>Теоретико-методичні засади управління фінансовими ризиками</b></p> <p>Тема 1. Теоретичні основи управління фінансовими ризиками.</p> <p>Тема 2. Політико-економічний ризик у системі ризик-менеджменту.</p> <p>Тема 3. Хеджування фінансових ризиків на ринку строкових угод.</p> <p>Тема 4. Інтеграція страхових організацій та комерційних банків у сфері ризик-менеджменту.</p> <p style="text-align: center;"><i>Змістовий модуль 2.</i></p> <p><b>Види фінансових ризиків, методи їх аналізу та оцінки</b></p> <p>Тема 5. Управління інвестиційними ризиками.</p> <p>Тема 6. Ризик неплатоспроможності суб'єктів господарювання.</p> <p>Тема 7. Кредитний ризик в системі фінансових відносин.</p>

	<p>Тема 8. Управління фінансовими ризиками на іпотечному ринку.</p> <p>Тема 9. Особливості управління фінансовими ризиками в банківській діяльності.</p> <p>Тема 10. Відсотковий ризик, методи аналізу та управління.</p> <p>Тема 11. Галузеве управління ризиками.</p>
<p><b>Методи навчання</b></p>	<p>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.</p>
<p><b>Політика</b></p>	<p><b>Політика щодо академічної доброчесності:</b> 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.</p> <p><b>Політика щодо відвідування занять:</b> 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.</p> <p><b>Політика щодо дедлайнів і перескладання:</b> здобувачі мають дотримуватися термінів виконання усіх видів робіт.</p> <p><b>Політика щодо виконання завдань:</b> позитивно оцінюється відповідальність, старанність, креативність.</p> <p><b>Політика оцінювання:</b> засоби та критерії оцінювання прописані в робочій програмі дисципліни, розміщеної на платформі Е-навчання Білоцерківського НАУ (Moodle).</p>
<p><b>Рекомендовані джерела інформації</b></p>	<p><b>Базова література</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Бальбанов И.Т. Риск-менеджмент / И.Т. Бальбанов. – М.: Финансы и статистика, 2016. – 186 с.</li> <li>2. Банківські ризики : теорія та практика управління: монографія / Л. О. Примостка, О. В.</li> </ol>

Лисенюк, О.О. Чуб; Мін-во освіти і науки України, ДВНЗ «КНЕУ» ім. Вадима Гетьмана». – К.: КНЕУ, 2015. – 456 с.

3. Васильчишин О. Б. Фінансова безпека банківської системи України: філософські детермінанти: монографія. Тернопіль: ТНЕУ, 2017. 358 с. ISBN 978-966-654-484-4

4. Вітлінський В.В. Ризик у менеджменті /В. В. Вітлінський, СІ. Наконечний. – К. : Борисфен-М, 2016. – 336 с.

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. 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](http://www.bulentsenver.com/FIN5477/Financial_Institutions_Management_AntonySaunders_TextBook.pdf)

6. Transforming risk efficiency and effectiveness, 2019. URL:

<https://www.mckinsey.com/business-functions/risk/our-insights/transforming-risk-efficiency-and-effectiveness>