

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

	<p>СИЛАБУС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ «УПРАВЛІННЯ ФІНАНСОВИМИ РИЗИКАМИ»</p> <p>Галузь знань – 07 «Управління та адміністрування» Спеціальність – 071 «Облік і оподаткування» Освітня програма – «Облік і оподаткування»</p>
Рівень вищої освіти	другий (магістерський)
Компонент освітньої програми:	вибіркова
Кількість кредитів ECTS /загальна кількість годин	3 кредити / 90 годин
Семестр	3
Форма контролю	залік
Мова викладання	українська
<p>Профайл викладача</p> 	<p>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</p>
Опис дисципліни	<p>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.</p>
Передумови для вивчення дисципліни	<p>Вибіркова навчальна дисципліна «Управління фінансовими ризиками» базується на знаннях з таких дисциплін як «Мікро- та макроекономіка», «Фінанси», «Гроші та кредит», «Фінансовий облік», «Облік в банках» вивчених на першому (бакалаврському) рівні вищої освіти.</p>
Мета вивчення	Метою навчальної дисципліни «Управління фінансовими

дисципліни	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	<ol style="list-style-type: none"> 1. Здійснювати адаптацію та модифікацію існуючих наукових підходів і методів до конкретних ситуацій професійної діяльності. 2. Відшукувати, 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	<p style="text-align: center;"><i>Змістовий модуль 1</i></p> <p>Теоретико-методичні засади управління фінансовими ризиками</p> <p>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.</p> <p style="text-align: center;"><i>Змістовий модуль 2</i></p> <p>Види фінансових ризиків, методи їх аналізу та оцінки</p> <p>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.</p>
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

	<p>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>Вид контролю та критерії оцінювання</p>	<p>Поточний контроль: активність в дискусії на лекційних заняттях, усне опитування, перевірка виконання практичних завдань, завдань для самостійної роботи, індивідуального науково-дослідного завдання. Модульний контроль може проводитися у формі комп'ютерного тестування або виконання письмового завдання.</p> <p style="text-align: center;">Розподіл балів, що присвоюється здобувачам вищої освіти за підсумкового контролю «залік»</p> <table border="1" data-bbox="624 651 1497 804"> <thead> <tr> <th>Види робіт</th> <th>Лекції</th> <th>Практичні заняття</th> <th>Самостійна робота</th> <th>Модульний контроль</th> <th>ІНДЗ</th> <th>Загальний бал</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Максимально можлива кількість балів</td> <td>10</td> <td>30</td> <td>10</td> <td>40</td> <td>10</td> <td>100</td> </tr> </tbody> </table> <p style="text-align: center;">Шкала оцінювання успішності здобувачів вищої освіти</p> <table border="1" data-bbox="617 898 1497 1267"> <thead> <tr> <th rowspan="2">За 100-бальною шкалою</th> <th rowspan="2">За шкалою ECTS</th> <th colspan="2">За національною шкалою</th> </tr> <tr> <th>іспит</th> <th>залік</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90–100</td> <td>A</td> <td>Відмінно</td> <td rowspan="5">Зараховано</td> </tr> <tr> <td>82–89</td> <td>B</td> <td>Добре</td> </tr> <tr> <td>75–81</td> <td>C</td> <td rowspan="3">Задовільно</td> </tr> <tr> <td>64–74</td> <td>D</td> </tr> <tr> <td>60–63</td> <td>E</td> </tr> <tr> <td>35–59</td> <td>FX</td> <td colspan="2">Незадовільно (не зараховано) з можливістю повторного складання</td> </tr> <tr> <td>1–34</td> <td>F</td> <td colspan="2">Незадовільно (не зараховано) з обов'язковим повторним вивченням</td> </tr> </tbody> </table>	Види робіт	Лекції	Практичні заняття	Самостійна робота	Модульний контроль	ІНДЗ	Загальний бал	Максимально можлива кількість балів	10	30	10	40	10	100	За 100-бальною шкалою	За шкалою ECTS	За національною шкалою		іспит	залік	90–100	A	Відмінно	Зараховано	82–89	B	Добре	75–81	C	Задовільно	64–74	D	60–63	E	35–59	FX	Незадовільно (не зараховано) з можливістю повторного складання		1–34	F	Незадовільно (не зараховано) з обов'язковим повторним вивченням	
Види робіт	Лекції	Практичні заняття	Самостійна робота	Модульний контроль	ІНДЗ	Загальний бал																																					
Максимально можлива кількість балів	10	30	10	40	10	100																																					
За 100-бальною шкалою	За шкалою ECTS	За національною шкалою																																									
		іспит	залік																																								
90–100	A	Відмінно	Зараховано																																								
82–89	B	Добре																																									
75–81	C	Задовільно																																									
64–74	D																																										
60–63	E																																										
35–59	FX	Незадовільно (не зараховано) з можливістю повторного складання																																									
1–34	F	Незадовільно (не зараховано) з обов'язковим повторним вивченням																																									
<p>Політика</p>	<p>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.</p> <p>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 онлайн режимі.</p> <p>Політика щодо дедлайнів і перескладання: здобувачі мають дотримуватися термінів виконання усіх видів робіт.</p> <p>Політика щодо виконання завдань: позитивно оцінюється відповідальність, старанність, креативність.</p> <p>Політика оцінювання: засоби та критерії оцінювання прописані в робочій програмі дисципліни, розміщеної на платформі Е-навчання Білоцерківського НАУ (Moodle).</p>																																										

**Рекомендовані
джерела інформації**

Базова література

1. Бальбанов И.Т. Риск-менеджмент / И.Т. Бальбанов. М.: Финансы и статистика, 2016. 186 с.
2. Банківські ризики : теорія та практика управління: монографія / Л. О. Примостка, О. В. 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, С.І. 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
6. Transforming risk efficiency and effectiveness, 2019. URL: <https://www.mckinsey.com/business-functions/risk/ourinsights/transforming-risk-efficiency-and-effectiveness>.