

Силабус (Syllabus)

Назва дисципліни	УПРАВЛІННЯ ФІНАНСОВИМИ РИЗИКАМИ
	Інформація про викладача
Викладач	ГРИНЧУК ТЕТЯНА ПЕТРІВНА, кандидат економічних наук тел. - 097-518-77-15 сайт – http://vki.vin.ua/ e-mail: tgrynychuk28@gmail.com
	Опис навчальної дисципліни
Обсяг	Кредитів - 120 годин / 4 кредити Лекцій - 24 годин Семінарських - 22 години Самостійна робота студентів - 72 години
Мова викладання	українська
Семестр / форма підсумкової атестації	6 семестр / залік
Політика академічної доброчесності	https://drive.google.com/file/d/11WWuPPYioYwWi7QIE1Ctc9YqfLNleVUN/view
Короткий опис курсу	В умовах невизначеності для одержання економічного прибутку підприємств повинен знати, що потрібно не уникати неминучого ризику, а вміти відчувати ризик, оцінювати його ступінь і не переходити за припустимі межі. З огляду на це велику увагу варто приділяти вивченню основних методів управління ризиками, пошуку способів і напрямів їх мінімізації. Дисципліна «Управління фінансовими ризиками» призначена для формування у майбутніх фахівців знань, які дають змогу студенту глибоко усвідомити питання сутності фінансових ризиків, управління фінансовими ризиками, механізму оцінки та зниження їх негативного впливу на господарську діяльність суб'єктів господарювання, сприяти прийняттю оптимальних фінансових рішень.
Мета та завдання курсу	Метою вивчення дисципліни «Управління фінансовими ризиками» є оволодіння студентами системою знань з теорії, методологією і методикою управління фінансовими ризиками, а також закріплення набутих знань під час розв'язання практичних завдань і господарських ситуацій. Основними завданнями, що мають бути вирішені в процесі викладання дисципліни, є: – вміння ідентифікувати види фінансових ризиків і знати особливості їх прояву для фінансово-кредитних установ та суб'єктів господарювання нефінансового сектору економіки; – вміння застосовувати принципи і методи управління фінансовими ризиками, а також знати сучасну практику управління фінансовими ризиками в Україні та світі; – навички із дослідження сучасних тенденцій розвитку світового фінансового ринку з метою своєчасного виявлення ключових факторів фінансових ризиків; – навички розраховувати та оцінювати показники рівня фінансових ризиків; – знати сутність та вміти оцінювати відповідність нормативам, компонентам

	системи управління кредитним ризиком і методам його оцінки; – знати види валютних операцій, умови і можливості їх здійснення; – навички використання методів оцінювання валютного ризику; – вміння розрізняти види процентного ризику, ідентифікувати компоненти системи, фактори та застосовувати принципи і методи управління процентним ризиком; – вміння застосовувати основні підходи до оцінки та управління ринковим ризиком, зокрема на основні деривативів та управління портфелем.
Курс має на меті сформулювати та розвинути наступні компетентності студентів: Загальні компетентності Спеціальні компетентності	ЗК02. Здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях. ЗК03. Здатність планувати та управляти часом. ЗК05. Навички використання інформаційних та комунікаційних технологій. ЗК07. Здатність вчитися і оволодівати сучасними знаннями. ЗК08. Здатність до пошуку, оброблення та аналізу інформації з різних джерел. ЗК15. Здатність ухвалювати рішення та діяти, дотримуючись принципу неприпустимості корупції та будь-яких інших проявів не доброчесності. СК03. Здатність до діагностики стану фінансових систем (державні фінанси, у тому числі бюджетна та податкова системи, фінанси суб'єктів господарювання, фінанси домогосподарств, фінансові ринки, банківська система та страхування <i>та фондові ринки</i>). СК06. Здатність застосовувати сучасне інформаційне та програмне забезпечення для отримання та обробки даних у сфері фінансів, банківської справи, страхування <i>та фондового ринку</i>. СК07. Здатність складати та аналізувати фінансову звітність. СК08. Здатність виконувати контрольні функції у сфері фінансів, банківської справи, страхування <i>та фондового ринку</i>. СК10. Здатність визначати, обґрунтовувати та брати відповідальність за професійні рішення. СК11. Здатність підтримувати належний рівень знань та постійно підвищувати свою професійну підготовку.
Програмні результати навчання	ПР04. Знати механізм функціонування державних фінансів, у т.ч. бюджетної та податкової систем, фінансів суб'єктів господарювання, фінансів домогосподарств, фінансових ринків, банківської системи, страхування <i>та фондові ринки</i>. ПР05. Володіти методичним інструментарієм діагностики стану фінансових систем (державні фінанси, у т.ч. бюджетна та податкова системи, фінанси суб'єктів господарювання, фінанси домогосподарств, фінансові ринки, банківська система, страхування <i>та фондові ринки</i>). ПР09. Формувати і аналізувати фінансову звітність та правильно інтерпретувати отриману інформацію. ПР10. Ідентифікувати джерела та розуміти методологію визначення і методи отримання економічних даних, збирати та аналізувати необхідну фінансову інформацію, розраховувати показники, що характеризують стан фінансових систем. ПР11. Володіти методичним інструментарієм здійснення контрольних функцій у сфері фінансів, банківської справи та страхування. ПР12. Використовувати професійну аргументацію для донесення інформації, ідей, проблем та способів їх вирішення до фахівців і нефахівців у фінансовій сфері діяльності. ПР16. Застосовувати набуті теоретичні знання для розв'язання практичних завдань та змістовно інтерпретувати отримані результати. ПР20. Виконувати функціональні обов'язки в групі, пропонувати обґрунтовані фінансові рішення.

Структура дисципліни	Назви тем	Кількість годин									форми контролю	
		денна форма					Заочна форма					
		усього	у тому числі				усього	у тому числі				
			лекції	практичні	семінарські	самостійна робота		лекції	практичні	семінарські		самостійна робота
	Тема 1. Вступ до курсу «Управління фінансовими ризиками»	18	4	2		12					ВОК, О, ТК, ПВЗ	
	Тема 2. Основи оцінки фінансових ризиків	20	4	4		12					ВОК, О, ТК, ПВЗ	
	Тема 3. Управління кредитним ризиком	20	4	4		12					ВОК, О, ТК, ПВЗ	
	Тема 4. Управління валютним ризиком	20	4	4		12					ВОК, О, ТК, ПВЗ	
	Тема 5. Управління процентним ризиком	20	4	4		12					ВОК, О, ТК, ПВЗ	
Тема 6. Управління ринковим ризиком	20	4	4		12					ВОК, О, ТК, ПВЗ		
ПМК	2									МКР		
Усього годин	120	24	22		72							
Підсумковий контроль – залік.												
Політика дисципліни												
Форми контролю	- усне та письмове опитування - О; - ведення опорного конспекту – ВОК; - перевірка виконання завдань – ПВЗ; - тестовий контроль - ТК; - модульна контрольна робота – МКР; - залік – З.											

**Список
рекомендо-ваних
джерел**

Лактіонова О. А. Управління фінансовими ризиками: навчальний посібник / Вінниця: ДонНУ імені Василя Стуса, 2020. 256 с.

Інформаційні ресурси

1. Офіційний сайт Верховної ради України [Електронний ресурс] – Режим доступу: <http://portal.rada.gov.ua>
2. Офіційний сайт Президента України [Електронний ресурс] – Режим доступу: <http://president.gov.ua>
3. Офіційний сайт Кабінету Міністрів України [Електронний ресурс] – Режим доступу: <http://kmu.gov.ua>
4. Офіційний сайт Державної фіскальної служби України [Електронний ресурс] – Режим доступу: <http://sfs.gov.ua>