

СИЛАБУС

з дисципліни «Управління фінансовими ризиками»
на отримання ступеню вищої освіти «магістр» за спеціальністю
242 «Туризм і рекреація»

Навчально-наукового інституту управління, економіки та бізнесу
ПрАТ «ВНЗ «Міжрегіональна Академія управління персоналом»

Обсяг курсу – 90 годин (3 кредити ЄКТС), з них: 34 години аудиторної роботи; 56 годин –
самостійної роботи, залік.

Викладач курсу – Кришталь Галина Олександрівна – доктор економічних наук,
професор, завідувач кафедри фінансів, банківської та страхової справи ННІУЕБ
(<https://maup.com.ua/ua/pro-akademiyu/instituti/institut-ekonomiki/kafedra-bank-strahovoi-spravi/krishtal-galina-oleksandrivna.html>).

Опис курсу

Пререквізитами курсу є знання основ сучасної економічної теорії та концепції ризик-менеджменту. Здобувач повинен мати достатню теоретичну і практичну підготовку з таких дисциплін: «Фінансовий менеджмент», «Валютна політика», «Страховий менеджмент», «Проектне фінансування».

Мета курсу – оволодіння здобувачами системою знань з теорії, методології і методики управління фінансовими ризиками, а також закріплення набутих знань під час розв'язання практичних завдань.

Завдання курсу:

- набути вміння ідентифікувати види фінансових ризиків і знати особливості їх прояву для фінансово-кредитних установ та суб'єктів господарювання нефінансового сектору економіки;
- сформувати вміння застосовувати принципи і методи управління фінансовими ризиками, а також знати сучасну практику управління фінансовими ризиками в Україні та світі;
- набути навички із дослідження сучасних тенденцій розвитку світового фінансового ринку з метою своєчасного виявлення ключових факторів фінансових ризиків;
- набути навички розраховувати та оцінювати показники рівня фінансових ризиків;
- засвоїти сутність та вміти оцінювати відповідність нормативам, компонентам системи управління кредитним ризиком і методам його оцінки;
- засвоїти види валютних операцій, умови і можливості їх здійснення;
- набути навички використання методів оцінювання валютного ризику;
- сформувати вміння розрізняти види процентного ризику, ідентифікувати компоненти системи, фактори та застосовувати принципи і методи управління процентним ризиком;
- сформувати вміння застосовувати основні підходи до оцінки та управління ринковим ризиком, зокрема на основні деривативів та управління портфелем.

У результаті вивчення курсу здобувачі повинні:

Знати: сутність фінансового ризику та причини його виникнення; класифікацію фінансових ризиків за ключовими ознаками; основні методи виявлення фінансового ризику; основні методи кількісного аналізу фінансових ризиків; характеристики фінансових ризиків; основні поняття фінансового ризик-менеджменту; основи організації процесу управління фінансовими ризиками; інформаційно-аналітичне забезпечення фінансової безпеки бізнесу.

Уміти: ідентифікувати фінансові ризики діяльності господарюючих суб'єктів; здійснювати якісний та кількісний аналіз ступеню фінансового ризику статистичним та експертним методами; здійснювати якісний та кількісний аналіз ступеню фінансового ризику аналітичним методом та методом аналогів; аналізувати ефективність методів управління фінансовим ризиком;

Компетентності. Вивчення курсу «Управління фінансовими ризиками» формує ключові компетентності: здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу; вміння виявляти, ставити та вирішувати проблеми; здатність до організації, планування, прогнозування результатів діяльності.

Результати навчання. У результаті вивчення курсу «Управління фінансовими ризиками» здобувачі повинні володіти методичним інструментарієм діагностики стану корпоративних фінансів, обґрунтовувати вибір і порядок формування інвестиційного портфелю на міжнародних ринках, здійснювати безперервний контроль та аудит за зміною його структури та ризикованості з подальшим прийняття відповідних ефективних управлінських рішень.

Структура курсу

Змістовий модуль 1 «Теоретико-методичні засади управління фінансовими ризиками»

Тема 1 Теоретичні основи управління фінансовими ризиками.

Тема 2 Особливості ризик-менеджменту суб'єктів фінансової діяльності

Тема 3. Система кількісних оцінок фінансового ризику.

Тема 4. Інтеграція страхових організацій та комерційних банків у сфері ризик-менеджменту

Тема 5. Хеджування фінансових ризиків на ринку строкових угод

Змістовий модуль 2 «Види фінансових ризиків, методи їх аналізу та оцінки»

Тема 6. Політико-економічний ризик у системі ризик-менеджменту.

Тема 7. Управління ризиками проектного фінансування.

Тема 8. Управління ризиками портфелю фінансових інструментів.

Тема 9. Ризик неплатоспроможності суб'єктів господарювання.

Тема 10. Кредитний ризик в системі фінансових відносин.

Тема 11. Управління фінансовими ризиками на іпотечному ринку.

Тема 12. Особливості управління фінансовими ризиками в банківській діяльності.

Тема 13. Відсотковий ризик, методи аналізу та управління. Управління ризиком ліквідності.

Тема 14. Валютні ризики суб'єктів господарювання, методи аналізу і управління

Політика курсу – спрямована на забезпечення активної участі здобувачів у навчальному процесі, розвитку їхніх аналітичних навичок і критичного мислення. Основна увага приділяється самостійній роботі, підготовці до семінарських занять, участі в дискусіях, вирішенні практичних кейсів і підготовці проектів. Оцінювання знань здійснюється на основі поточної успішності, виконання індивідуальних і групових завдань, підсумкових тестів і захисту курсової роботи. Під час вивчення курсу здобувачі зобов'язані дотримуватися академічної доброчесності та етичних норм.

Система оцінювання – оцінювання знань здійснюється відповідно до «Положення про оцінювання навчальних досягнень здобувачів вищої освіти у ПрАТ «ВНЗ «МАУП» (https://drive.google.com/file/d/1ENRncPY-dU2qLke7aw_VKn1OdfG8_8Hg8D/view).

Система оцінювання навчальних досягнень

| Вид діяльності здобувача | Максимальна кількість балів за одиницю | Модуль 1 | | Модуль 2 | |
|----------------------------------|--|-------------------|-----------------------------|-------------------|-----------------------------|
| | | кількість одиниць | максимальна кількість балів | кількість одиниць | максимальна кількість балів |
| Відвідування лекцій | 1 | 4 | 4 | 6 | 6 |
| Відвідування семінарських занять | 1 | 3 | 3 | 4 | 4 |
| Робота на семінарському занятті | 10 | 2 | 20 | 5 | 50 |

| | | | | | |
|---|------------|---|----|---|-----|
| Виконання завдань для самостійної роботи | 5 | 5 | 25 | 9 | 45 |
| Виконання модульної роботи | 25 | 1 | 25 | 1 | 25 |
| Виконання ІНДЗ | 30 | - | - | - | - |
| Разом | - | - | 77 | - | 130 |
| Максимальна кількість балів: | 237 | | | | |
| 237:100=2,37. Здобувач набрав X балів; Розрахунок: X:2,37 = загальна кількість балів. | | | | | |

Інформаційні ресурси

1. Бібліотека ім. В.І. Вернадського. URL: <http://www.nbu.gov.ua/>
2. Бібліотека ім. В.Г. Короленко. URL: <http://korolenko.com.ua/>
3. Бібліотека МАУП URL: <https://maup.com.ua/ua/pro-akademiyu/biblioteka.html/>
4. Електронна бібліотека URL: <http://lib.meta.ua/>
5. Нормативно-правова база України URL: <http://zakon.rada.gov.ua/>