

	<p style="text-align: center;"><b>СИЛАБУС</b>  <b>НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ</b>  <b>«УПРАВЛІННЯ ФІНАНСОВИМИ</b>  <b>РИЗИКАМИ»</b></p> <p><b>Рівень вищої освіти:</b> Другий (магістерський)  <b>Спеціальність:</b> <u>072 Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок</u>  <b>Рік навчання:</b> <u>1-й, семестр 2-й</u>  <b>Кількість кредитів ECTS:</b> <u>4 кредити</u>  <b>Назва кафедри:</b> <u>Фінанси, банківська справа та страхування</u>  <b>Мова викладання:</b> <u>українська</u></p>
<b>Лектор курсу</b>	д.е.н., проф. Алескерова Юлія Володимирівна
<b>Контактна інформація лектора (e-mail)</b>	<u><a href="mailto:alesk@vsau.vin.ua">alesk@vsau.vin.ua</a></u> , <u><a href="mailto:aleskerovaaleskerova@gmail.com">aleskerovaaleskerova@gmail.com</a></u>

### **ОПИС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ**

Навчальна дисципліна «Управління фінансовими ризиками» є вибірковою компонентою ОПП.

Загальний обсяг дисципліни 120 год.: лекції - 24 год.; практичні заняття - 22 год., самостійна робота - 74 год.

Формат проведення: лекції, практичні заняття, семінарські заняття, консультації. Підсумковий контроль – залік.

При вивченні даної дисципліни використовуються знання, отримані з такої дисципліни: «Міжнародний агробізнес».

Основні положення навчальної дисципліни можуть застосовуватися при вивченні таких дисциплін: «Податковий менеджмент», «Страховий менеджмент»

### **Призначення навчальної дисципліни**

Дисципліна спрямована на забезпечення фундаментальної і практичної професійної підготовки в області теорії і практики управління фінансовими ризиками, а також засвоєння методів оцінки результативності управління фінансовими ризиками, на забезпечення формування системи знань про сучасні методи у розвитку управління фінансовими ризиками.

### **Мета вивчення навчальної дисципліни**

Метою вивчення навчальної дисципліни «Управління фінансовими ризиками» є полягає у досягненні студентами належного рівня професійних знань, вмінь та навичок у галузі управління фінансами, ризик-менеджменту в сфері фінансових взаємовідносин суб'єктів господарської діяльності.

### **Завдання вивчення дисципліни**

Теоретична та практична підготовка, самостійно виявляти проблеми економічного характеру при аналізі конкретних ситуацій, пропонувати способи їх вирішення, використовувати аналітичний та методичний інструментарій для обґрунтування економічних рішень.

### **ПЕРЕЛІК КОМПЕТЕНТНОСТЕЙ, ЯКИХ НАБУВАЄ ЗДОБУВАЧ ПРИ ВИВЧЕННІ ДИСЦИПЛІНИ ВІДПОВІДНО ДО ОСВІТНЬОЇ ПРОГРАМИ**

У результаті вивчення навчальної дисципліни здобувач повинен сформувати такі програмні компетентності:

*інтегральну компетентність* - здатність розв'язувати складні задачі і проблеми у професійній діяльності або у процесі навчання у сфері фінансів, банківської справи та страхування, що передбачає проведення досліджень та/або здійснення інновацій та характеризується невизначеністю умов і вимог.

*загальні компетентності (ЗК):*

ЗК3. Здатність проведення досліджень на відповідному рівні.

ЗК4. Вміння виявляти, ставити та вирішувати проблеми.

ЗК5. Здатність приймати обґрунтовані рішення.

ЗК9. Здатність діяти на основі етичних міркувань (мотивів);

*спеціальні (фахові, предметні) компетентності (СК):*

СК1. Здатність використовувати фундаментальні закономірності розвитку фінансів, банківської справи та страхування у поєднанні з дослідницькими і управлінськими інструментами для здійснення професійної та наукової діяльності.

СК3. Здатність застосовувати управлінські навички у сфері фінансів, банківської справи та страхування.

СК7. Здатність до пошуку, використання та інтерпретації інформації, необхідної для вирішення професійних і наукових завдань в сфері фінансів, банківської справи та страхування.

СК8. Здатність застосовувати інноваційні підходи в сфері фінансів, банківської справи та страхування.

### **ПРОГРАМНІ РЕЗУЛЬТАТИ НАВЧАННЯ ВІДПОВІДНО ДО ОСВІТНЬОЇ ПРОГРАМИ**

ПР01. Використовувати фундаментальні закономірності розвитку фінансів, банківської справи та страхування у поєднанні з дослідницькими і управлінськими інструментами для здійснення професійної та наукової діяльності.

ПР09. Застосовувати управлінські навички у сфері фінансів, банківської справи та страхування.

ПР11. Застосовувати поглиблені знання в сфері фінансового, банківського та страхового менеджменту для прийняття рішень.

ПР12. 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.

### **ПЛАН ВИВЧЕННЯ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ**

№ з/п	Назви теми	Форми організації навчання та кількість годин		Самостійна робота, кількість годин
		лекційні заняття	практичні заняття	
1	<b>Тема 1.</b> Управління фінансами ризиками: суть та функції дисципліни	2	2	6
2	<b>Тема 2.</b> Основи оцінки фінансових ризиків	2	2	6
3	<b>Тема 3.</b> Управління кредитними ризиком	2	2	6
4	<b>Тема 4.</b> Управління валютним ризиком	2	2	6
5	<b>Тема 5.</b> Управління процентним ризиком	2	2	6
6	<b>Тема 6.</b> Управління ринковим ризиком	2	2	6
7	<b>Тема 7.</b> Якісні методи оцінювання ризиків	2	2	6
8	<b>Тема 8.</b> Матричні методи та критерії прийняття ризикових рішень в умовах невизначеності.	2	2	6
9	<b>Тема 9.</b> Застосування теорії ігор в умовах ризику	2	2	6
10	<b>Тема 10.</b> Основні напрями впливу на ризик	2	2	6
11	<b>Тема 11.</b> Страхування ризиків	2	1	7
12	<b>Тема 12.</b> Диверсифікація ризиків, її види та сфери застосування	2	1	7
<b>Разом</b>		<b>24</b>	<b>22</b>	<b>74</b>

#### **Самостійна робота здобувача вищої освіти**

Самостійна робота студента організовується шляхом видачі індивідуального переліку питань і практичних завдань з кожної теми, які не виносяться на аудиторне опрацювання та виконання індивідуального творчого завдання.

Самостійна робота здобувача є одним із способів активного, цілеспрямованого набуття нових для нього знань та умінь. Вона є основою його підготовки як фахівця, забезпечує набуття ним прийомів пізнавальної діяльності, інтерес до творчої роботи, здатність вирішувати наукові та практичні завдання.

Виконання здобувачем самостійної роботи передбачає, за необхідності, отримання консультацій або допомоги відповідного фахівця. Навчальний матеріал навчальної дисципліни, передбачений робочою програмою навчальної дисципліни для засвоєння здобувачем у процесі самостійної роботи, виносяться на поточний і підсумковий контроль поряд з навчальним матеріалом, який опрацьовувався під час аудиторних занять. Організація самостійної роботи здобувачів передбачає: планування обсягу, змісту, завдань, форм і методів контролю самостійної роботи, розробку навчально-методичного забезпечення; виконання здобувачем запланованої самостійної

роботи; контроль та оцінювання результатів, їх систематизацію, оцінювання ефективності виконання здобувачем самостійної роботи.

Індивідуальні завдання здобувач виконує самостійно під керівництвом викладача згідно з індивідуальним навчальним планом. У випадку реалізації індивідуальної освітньої траєкторії здобувача заняття можуть проводитись за індивідуальним графіком. Під час роботи над індивідуальними завданнями, розв'язуванням задач не допустимо порушення академічної доброчесності. Презентації та виступи мають бути авторськими та оригінальними.

#### **Види самостійної роботи**

№ з/п	Вид самостійної роботи	Години	Терміни виконання	Форма та метод контролю
1	Підготовка до лекційних та практичних занять	20	раз на 2 тижня	Усне та письмове опитування
2	Підготовка самостійних питань з тематики дисципліни	20	2 рази на семестр	Усне та письмове опитування
3	Індивідуальні творчі завдання (виконання презентації за заданою проблемною тематикою)	20	2 рази на семестр	Спостереження за виконанням, обговорення, виступ з презентацією, усний захист
4	Підготовка до контрольних робіт та тестування	14	2 рази на семестр	Тестування у системі Мудл
<b>Разом</b>		<b>74</b>		

### **РЕКОМЕНДОВАНІ ДЖЕРЕЛА ІНФОРМАЦІЇ**

#### **Основна література**

1. Алескерова Ю.В. Фінансовий ринок. Підручник. Хмельницький, 2019 р. 384с.
2. Вдовенко Л.О. Гроші і кредит. Навч. посіб. К.: ФОП Корзун Д.Ю. 2013. 186 с.
3. Вдовенко Л.О. Кредитування в АПК. Навчальний посібник. Вінниця, 2019. 148 с
4. Фінанси: Навчальний посібник: експрес курс за заг. ред. Волохової І. С. Харків: Видавництво «ПромАрт». 2018. 262 с
5. Ярошевич Н.Б. Фінанси: Навчальний посібник. Львів: Видавництво «Простір-М». 2018. 298с.

#### **Додаткова література**

1. Управління фінансовими ризиками: навч. посіб. К.Знання, 2010. 598 с.
2. Система ризик-менеджменту в банках: теоретичні та методологічні аспекти: монографія. Одеса: ОНЕУ, 2017. 304 с.
3. Посохов І. М., Управління ризиками у підприємстві: навчальний посібник. Харків. НТУ «ХПІ», 2015. 220 с.
4. Вдовенко Л.О. Кредитні ризики в системі банківського кредитування. Економічний часопис XXI. 2013. №3-4. С.79-82.
5. Вдовенко Л.О., Черненко Д.С., Кельман О.В. Управління капіталом –

основа ефективності функціонування підприємств аграрної сфери. Фінансовий простір. 2015. №4(20). С.139-142.

6. Вдовенко Л.О., Черненко О.С. Інформаційна складова забезпечення фінансової безпеки суб'єктів підприємництва аграрної сфери економіки. Збірник наукових праць Уманського національного університету садівництва. 2016. Ч.2. Економічні науки. Вип.89. С.45-53.

7. Вдовенко Л.О., Воловодівський Р.Р., Євтухівський М.С. Формування ефективного механізму кредитування малого та середнього бізнесу в Україні. Інфраструктура ринку. 2018. № 20. С. 221-226.

8. Вдовенко Л.О., Михальчишин М.С., Степовий В.О. Роль фінансового менеджменту в діяльності підприємств. Інтернаука. 2018. №13(53). С. 11-15

9. Вдовенко Л.О., В.М. Недомовна, А.А. Курілець Управління активами в забезпеченні фінансової безпеки підприємства. Економічні та соціальні перспективи децентралізації в Україні : монографія під заг. ред. Ю.З. Драчука, В.Я.Швеця, М.С. Пашкевич. Дніпропетровськ.: НГУ. 2016. С.66-73.

10. Вдовенко Л.О. Фінансова безпека суб'єктів підприємництва в аграрній сфері: Монографія / Л.О. Вдовенко, О.С.Черненко. Вінниця: Монографія. Вінниця: ТОВ «Нілан-ЛТД». 2017. 252 с.

### **Інформаційні ресурси**

1. Бібліотека економіста. URL: [http:// www.library.if.ua](http://www.library.if.ua)
2. Офіційний сайт Верховної Ради України. URL: [rada.gov.ua](http://rada.gov.ua)
3. Офіційний сайт Кабінету Міністрів України. URL: [kmu.gov.ua](http://kmu.gov.ua)
4. Офіційний сайт Міністерства економіки України. URL: [me.gov.ua](http://me.gov.ua)
5. Офіційний сайт Держкомстату України. URL: [ukrstat.gov.ua](http://ukrstat.gov.ua)
6. Офіційний сайт Національного банку України. URL: [bank.gov.ua](http://bank.gov.ua)
7. Офіційний сайт Національної комісії з цінних паперів та фондового ринку. URL: <http://www.nssmc.gov.ua/>
8. Офіційний сайт Міністерства фінансів. URL: <http://www.minfint.gov.ua>
9. Офіційний сайт Світового банку. URL: <http://www.worldbank.org>.
10. Фінансовий ринок. URL: [http:// www.finmarket.info](http://www.finmarket.info)

## СИСТЕМА ОЦІНЮВАННЯ ТА ВИМОГИ ДО КОНТРОЛЮ ЗНАНЬ ЗДОБУВАЧІВ ВИЩОЇ ОСВІТИ

У кінці семестру, здобувач вищої освіти може набрати до 60% підсумкової оцінки за виконання всіх видів робіт, що виконуються протягом семестру, до 10% за показники наукової, інноваційної, навчальної, виховної роботи та студентської активності і до 30% підсумкової оцінки – за результатами підсумкового контролю.

### Розподіл балів, які отримують здобувач вищої освіти

Вид навчальної діяльності		Бали
<b>Атестація 1</b>		
1	Участь у дискусіях на лекційних заняттях	4
2	Участь у роботі на практичних заняттях	8
3	Виконання контрольної роботи / тестування	3
4	Атестація	10
5	Індивідуальні завдання	5
	<b>Всього за атестацію 1</b>	<b>30</b>
<b>Атестація 2</b>		
6	Участь у дискусіях на лекційних заняттях	4
7	Участь у роботі на практичних заняттях	8
8	Виконання контрольної роботи / тестування	3
9	Атестація	10
10	Індивідуальні завдання	5
	<b>Всього за атестацію 2</b>	<b>30</b>
	Показники наукової, інноваційної, навчальної, виховної роботи та студентської активності	<b>10</b>
	<b>Підсумкове тестування</b>	<b>30</b>
	<b>Разом</b>	<b>100</b>

### Відповідність шкал оцінок якості засвоєння навчального матеріалу

Сума балів за всі види навчальної діяльності	Оцінка ECTS	Оцінка за національною шкалою для заліку
90 – 100	A	зараховано
82-89	B	
75-81	C	
66-74	D	
60-65	E	
35-59	FX	не зараховано з можливістю повторного складання
0-34	F	не зараховано з обов'язковим повторним вивченням дисципліни