



СИЛАБУС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Назва курсу	Фінансовий ризик менеджмент
Викладач 	Мельник Тетяна Андріївна , кандидат економічних наук, доцент, доцент кафедри фінансів, банківської справи та страхування
Контактний тел.	+38(0522) 39-05-39
E-mail:	melnikta@kntu.kr.ua
Обсяг та ознаки дисципліни	Вибіркова дисципліна. Форма контролю: залік. Загальна кількість кредитів - 3, годин – 90. Формат: очний (offline / facetoface) / дистанційний (online). Мова викладання: українська. Рік викладання – 2024-2025.
Консультації	Консультації проводяться відповідно до Графіку, розміщеному в інформаційному ресурсі moodle.kntu.kr.ua; у режимі відео конференцій Zoom, через електронну пошту, Viber, Messenger, Telegram за домовленістю.
Пререквізити	Особливі вимоги відсутні, але ефективність засвоєння змісту дисципліни підвищиться, якщо здобувач попередньо опанував знання з фінансів

1. Мета і завдання дисципліни

Метою вивчення навчальної дисципліни «Фінансовий ризик менеджмент» є формування у здобувачів теоретичних основ фінансового ризик-менеджменту у сучасних умовах, опанування засобів та інструментів для оцінки фінансових ризиків з метою прийняття ефективних управлінських рішень.

Завдання вивчення дисципліни «Фінансовий ризик менеджмент» спрямовані на формування у здобувачів компетентності щодо: сутності, цілей, принципів та завдань ризик-менеджменту; усвідомлення необхідності системного підходу до вивчення особливостей використання методів, засобів та інструментів ризик-менеджменту на рівні держави, регіону, галузі, конкретного суб'єкта господарювання в сучасних умовах.

2. Результати навчання

У результаті вивчення навчальної дисципліни здобувач вищої освіти повинен:

знати:

- сутність поняття «фінансовий ризик менеджмент» та методи його забезпечення;
- основи теорії ризику та практичного її використання у великих економічних системах в умовах невизначеності та ризику;
- наукові підходи, практичні методи та прийоми ризик-менеджменту;
- умови передачі фінансових ризиків на страхування.

уміти:

- кількісно оцінювати ризик за допомогою різних методів;
- аналізувати різні ризикові ситуації у фінансовій діяльності;
- визначати умови профілактики виникнення фінансових ризиків шляхом прогнозування ризиків та їх своєчасної нейтралізації;
- проводити страхування фінансових ризиків.

набути соціальних навичок (soft-skills):

- здійснювати професійну комунікацію, зрозуміло пояснювати та презентувати матеріал, працювати в команді;
- взаємодіяти в економічному середовищі.

3. Політика курсу та академічна доброчесність

Очікується, що здобувачі вищої освіти будуть дотримуватися принципів академічної доброчесності, усвідомлювати наслідки її порушення.

При організації освітнього процесу в Центральноукраїнському національному технічному університеті здобувачі вищої освіти, викладачі та адміністрація діють відповідно до: Положення про організацію освітнього процесу; Положення про організацію вивчення вибіркового навчальних дисциплін та формування індивідуального навчального плану ЗВО; Кодексу академічної доброчесності ЦНТУ.

4. Програма навчальної дисципліни

Тема 1. Сутність фінансового ризику.

Тема 2. Класифікація ризиків у фінансах.

Тема 3. Економічний зміст фінансового ризик менеджменту.

Тема 4. Методи до кількісного оцінювання фінансових ризиків.

Тема 5. Методи до якісного оцінювання фінансових ризиків.

Тема 6. Методи управління ризиком у фінансовій сфері.

Тема 7. Страхування фінансового ризику.

Тема 8. Диверсифікація як метод зниження фінансового ризику.

5. Система оцінювання та вимоги

Види контролю: поточний, підсумковий.

Методи контролю: спостереження за навчальною діяльністю здобувачів, усне опитування, письмовий контроль.

Рейтинг здобувачів вищої освіти із засвоєння дисципліни визначається за 100 бальною шкалою, у тому числі:

- перший рубіжний контроль – 50 балів;
- другий рубіжний контроль – 50 балів.

Семестровий залік полягає в оцінці рівня засвоєння здобувачем вищої освіти навчального матеріалу на лекційних і практичних заняттях та виконання індивідуальних завдань за стобальною, дворівневою («зараховано», «не зараховано») та шкалою ЄКТС результатів навчання.

6. Рекомендована література

1. Партин Г. О., Селюченко Н. Є. Фінансовий менеджмент: підручник. Львів: Видавництво Львівської політехніки 2018. 388 с.

2. Долінський Л. Б. Фінансовий ризик-менеджмент : навч.-метод. посібник. Київ : Національний університет «Києво-Могилянська академія», 2022. 132 с. URL: <https://ekmair.ukma.edu.ua/items/612eбеса-ea2d-4f46-adbf-72aaabdaf988>

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

4. Фінансові ризики суб'єктів господарювання: навч. посіб. / за ред. д-ра екон. наук, професора Кнейслер О. В. Тернопіль: Осадца Ю. В., 2017. 138 с. URL: http://dspace.wunu.edu.ua/bitstream/316497/28458/1/%D0%9D%D0%B0%D0%B2%D1%87%D0%B0%D0%BB%D1%8C%D0%BD%D0%B8%D0%B9%20%D0%BF%D0%BE%D1%81%D1%96%D0%B1%D0%BD%D0%B8%D0%BA_%D0%A4%D0%A0%D0%A1%D0%93.pdf

Розглянуто і схвалено на засіданні кафедри фінансів, банківської справи та страхування, Протокол №1 від 29 серпня 2024 р.