



ОПИС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

1. Код: ВВ 5.2

2. Назва: *Фінансовий ризик-менеджмент;*

3. Тип: *вибіркова;*

4. Рівень вищої освіти: *II (магістерський)*

5. Рік навчання, коли пропонується дисципліна: *2;*

6. Семестр, коли вивчається дисципліна: *3;*

7. Кількість встановлених кредитів ЄКТС: *3;*

8. Прізвище, ініціали лектора, науковий ступінь, посада: *Кондрацька Н.М., к.е.н., доцент*

9. Результати навчання: *після вивчення дисципліни студент повинен бути здатним:*

- розуміти основи управління фінансовими ризиками;
- здійснювати аналіз та оцінку ризику різними методами;
- застосовувати сучасні поведінкові підходи для оцінки ризиків;
- здійснювати організацію та управління системою ризик-менеджменту;
- використовувати диверсифікацію, резервування та страхування для управління ризиками.

10. Форми організації занять: *навчальне заняття, самостійна робота;*

11. Дисципліни, що передують вивченню зазначеної дисципліни: *«Комплексне забезпечення фінансово-економічної безпеки», «Обґрунтування та реалізація проектів», «Фінансовий менеджмент у сфері бізнесу»*

12. Зміст курсу:

1. Теоретико-методичні основи управління ризиками
2. Експертні методи оцінки ризиків
3. Кількісні методи оцінки ризиків
4. Ризик та прийняття рішень в умовах невизначеності
5. Теорія корисності і оцінка ризиків
6. Поведінкова теорія в оцінці ризику
7. Система управління ризиками
8. Управління окремими видами ризиків

13. Рекомендовані навчальні видання:

1. Гуменюк В. Я., Міщук Г. Ю., Олійник О. О. *Управління ризиками: Навч. посіб. Рівне. : НУВГП, 2010. 158 с.*

2. Долінський Л. Б. *Фінансовий ризик-менеджмент : навч.-метод. посіб. : [для студентів екон. спец.] ; Нац. ун-т "Києво-Могилян. акад.". Київ : НаУКМА, 2022. 130 с*

3. Калініченко З. Д. *Ризик-менеджмент: навчальний посібник для здобувачів спец. 051 «Економіка» та 073 «Менеджмент». Дніпро: ДДУВС, 2021. 224 с*

Онищенко В.О., Андрєєв Р.Г., Савицька О.І., Довгаль Ю.С. *Економічна безпека банківської діяльності в Україні: монографія. Полтава: ПолтНТУ, 2011. 347 с.*

14. Заплановані види навчальної діяльності та методи викладання:

16 год. лекцій, 14 год. практичних занять, 60 год. самостійної роботи. Разом – 90 год.

Методи: інтерактивні лекції, елементи проблемної лекції, впровадження кейс-методів, використання мультимедійних засобів, навчальні відео.

15. Форми та критерії оцінювання:

Оцінювання здійснюється за 100-бальною шкалою.

Підсумковий контроль (40 балів): залік письмовий в кінці 3 семестру.

Поточний контроль (60 балів): тестування, опитування, виконання самостійної роботи

16. Мова викладання: *українська.*

Завідувач кафедри

Л. В. Мельник, к.е.н., професор



1. **Code:** VV 5.2;
2. **Title:** *Financial Risk Management*;
3. **Type:** *optional*;
4. **Higher education level:** *the first (Master's degree)*;
5. **Year of study, when the discipline is offered:** 2;
6. **Semester when the discipline is studied:** 3;
7. **Number of established ECTS credits:** 3;
8. **Surname, initials of the lecturer / lecturers, scientific degree, position:** *Kondraska N.M., Ph.D. Associate Professor*
9. **Results of studies:** *after studying this discipline student should be able to:*
 - *understand the fundamentals of financial risk management.*
 - *conduct risk analysis and assessment using various methods.*
 - *apply contemporary behavioral approaches to risk evaluation.*
 - *organize and manage a risk management system.*
 - *manage risk using diversification, reserves, and insurance.*
10. **Forms of Teaching:** *classroom lectures, independent study*;
11. **Disciplines preceding the study of the specified discipline:** *"Comprehensive Financial and Economic Security Provision", "Project Justification and Implementation", "Financial Management in the Business Sector"*
12. **Course contents:**
 1. *Theoretical and Methodological Foundations of Risk Management*
 2. *Expert Methods for Risk Assessment*
 3. *Quantitative Methods for Risk Assessment*
 4. *Risk and Decision-Making under Uncertainty*
 5. *Utility Theory and Risk Assessment*
 6. *Behavioral Theory in Risk Evaluation*
 7. *Risk Management System*
 8. *Managing Specific Types of Risks*
13. **Recommended educational editions:**
 1. *Humeniuk V. Ya., Mishchuk H. Yu., Oliinyk O. O. Upravlinnia ryzykamy: Navch. posib. Rivne. : NUVHP, 2010. 158 s.*
 2. *Dolinskyi L. B. Finansovyi ryzyk-menedzhment : navch.-metod. posib. : [dlia studentiv ekon. spets.] ; Nats. un-t "Kyievo-Mohylian. akad.". Kyiv : NaUKMA, 2022. 130 s*
 3. *Kalinichenko Z. D. Ryzyk-menedzhment: navchalnyi posibnyk dlia здобувачив spets. 051 «Ekonomika» ta 073 «Menedzhment». Dnipro: DDUVS, 2021. 224 s*
 4. *Onyshchenko V.O., Andrieiev R.H., Savytska O.I., Dovhal Yu.S. Ekonomichna bezpeka bankivskoi diialnosti v Ukraini: monohrafiia. Poltava: PoltNTU, 2011. 347 s.*
14. **Planned types of educational activities and teaching methods:**

Lectures – 16 hours, practical training – 14 hours, independent work – 60 hours. Total – 90 hours.

Methods of teaching: Interactive Lectures, Elements of Problem-Based Lectures, Implementation of Case Methods, Use of Multimedia Resources, Educational Videos.
15. **Forms and assessment criteria:** *The assessment is carried out on a 100-point scale:*

Final control (40 points): test at the end of the 3rd semester.

Current control (60 points): testing, questioning, problem solving, implementation of independent work, modular control.
16. **Language of teaching:** *Ukrainian.*

Head of the department

L.V. Melnik, Ph.D., professor