



Опис навчальної дисципліни

1. **Код:** BB5;
2. **Назва:** Фінансовий ризик-менеджмент;
3. **Тип:** вибірковий;
4. **Рівень вищої освіти:** II (магістерський);
5. **Рік навчання, коли пропонується дисципліна:** 2;
6. **Семестр, коли вивчається дисципліна:** 3;
7. **Кількість встановлених кредитів ЄКТС:** 4;
8. **Прізвище, ініціали лектора, науковий ступінь, посада:** Шило Ж.С., к.е.н., доцентка
9. **Результати навчання:** після вивчення дисципліни студент повинен бути здатним:
 - використовувати на практиці основні підходи до ідентифікації та класифікації фінансових ризиків, концептуальні методи їх аналізу;
 - оволодіти концептуальними підходами вимірювання фінансових ризиків;
 - застосувати на практиці набуті навички та знання для проведення аналізу і моделювання ринкових фінансових ризиків;
 - вміти проводити аналіз кількісної оцінки та моделювання кредитних ризиків;
 - визначати можливості проведення аналізу, підходів до оцінювання та моделювання операційного та інших видів ризику фінансових інститутів;
 - оцінювати використання методів та методик моделювання інтегрального ризику фінансових інститутів та «економічного капіталу» фінансових інститутів;
 - оволодіти концептуальними підходами до управління фінансовими ризиками та їх мінімізації – диверсифікація, страхування, хеджування, здобуття додаткової інформації тощо.
10. **Форми організації занять:** навчальне заняття, самостійна робота.
11. **Дисципліни, що передують вивченню зазначеної дисципліни:** «Фінансовий менеджмент у сфері бізнесу», «Страховий менеджмент», «Банківський менеджмент», «Антикризовий менеджмент та фінансова санація підприємств».
12. **Зміст курсу:**
 1. ПОНЯТТЯ, СУТНІСТЬ І ЗМІСТ РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТУ.
 2. ЕКОНОМІЧНА СУТНІСТЬ ТА ХАРАКТЕРИСТИКА РИЗИКІВ.
 3. КЛАСИФІКАЦІЯ РИЗИКІВ.
 4. ЗАКОНИ І ПРИНЦИПИ РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТУ.
 5. ПОКАЗНИКИ РИЗИКУ ТА МЕТОДИ ЙОГО ОЦІНЮВАННЯ.
 6. МЕТОДОЛОГІЯ РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТУ.
 7. ФІНАНСОВИЙ РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТ.
 8. ХЕДЖУВАННЯ ФІНАНСОВИХ РИЗИКІВ ТА ОПЕРАЦІЙ З ФІНАНСОВИМИ АКТИВАМИ З ВИКОРИСТАННЯМ ДЕРИВАТИВІВ.
 9. ОРГАНІЗАЦІЯ ТА ФУНКЦІОНУВАННЯ СИСТЕМ РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТУ В БАНКАХ УКРАЇНИ.
 10. СТРАХУВАННЯ ФІНАНСОВИХ РИЗИКІВ.
 11. КОНТРОЛІНГ ФІНАНСОВИХ РИЗИКІВ.
13. **Рекомендовані навчальні видання:**
 1. Боровик М.В. Ризик-менеджмент: конспект лекцій. Харків. Нац. ун-т міськ. госп-ва ім. О.М. Бекетова. Харків: ХНУМГ ім. О.М. Бекетова, 2018. 65 с.
 2. Демченко Г. В. Ризик менеджмент: конспект лекцій для студентів спеціальності 073 "Менеджмент" першого бакалаврського рівня. Харків : ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2021. 74 с.
 3. Долінський Л. Б. Фінансовий ризик-менеджмент : навч.-метод. посібник. Київ: Національний університет «Києво-Могилянська академія», 2022. 132 с.
 4. Лактіонова О. А. Управління фінансовими ризиками: навчальний посібник. Вінниця: ДонНУ імені Василя Стуса, 2020. 256 с.
14. **Заплановані види навчальної діяльності та методи викладання:**

26 год. лекцій, 16 год. практичних занять, 78 год. самостійної роботи. Разом – 120 год.

Методи: інтерактивні лекції, елементи проблемної лекції, індивідуальні завдання, впровадження кейс-методів, використання мультимедійних засобів.
15. **Форми та критерії оцінювання:**

Оцінювання здійснюється за 100-бальною шкалою.

Підсумковий контроль: залік в кінці 2 семестру.

Поточний контроль (100 балів): тестування, опитування, виконання самостійної роботи.
16. **Мова викладання:** українська.



Description of the discipline

1. **Code:** VV5;
 2. **Title:** *Financial risk management;*
 3. **Type:** *selective;*
 4. **Level of higher education:** *Master's (second);*
 5. **Year of study, when the discipline is proposed:** *2;*
 6. **Semester when studying discipline:** *3);*
 7. **Number of established ECTS credits:** *4;*
 8. **Surname, initials of the lecturer, scientific degree, position:** *Shilo J.S., Ph.D., associate professor*
 9. **Learning outcomes:** *after studying the discipline, the student must be able:*
 - *apply in practice the basic approaches to the identification and classification of financial risks, conceptual methods of their analysis;*
 - *master conceptual approaches to measuring financial risks;*
 - *apply in practice the acquired skills and knowledge to analyse and model market financial risks;*
 - *be able to analyse the quantification and modelling of credit risks;*
 - *determine the possibilities of analysing, approaches to assessing and modelling operational and other types of risk of financial institutions;*
 - *evaluate the use of methods and techniques for modelling the integrated risk of financial institutions and the "economic capital" of financial institutions;*
 - *master conceptual approaches to financial risk management and minimisation - diversification, insurance, hedging, obtaining additional information, etc.*
- Translated with DeepL.com (free version).*
10. **Forms of organization of classes:** *training classes, independent work, control measures.*
 11. **Disciplines preceding the study of the specified discipline:** *"Financial Management in Business», «Insurance Management», «Banking Management», «Crisis Management and Financial Rehabilitation of Enterprises».*
 12. **Content of the course:**
 1. *THE CONCEPT, ESSENCE AND CONTENT OF RISK MANAGEMENT.*
 2. *ECONOMIC ESSENCE AND CHARACTERISTICS OF RISKS.*
 3. *CLASSIFICATION OF RISKS.*
 4. *LAWS AND PRINCIPLES OF RISK MANAGEMENT.*
 5. *RISK INDICATORS AND METHODS OF RISK ASSESSMENT.*
 6. *METHODOLOGY OF RISK MANAGEMENT.*
 7. *FINANCIAL RISK MANAGEMENT.*
 8. *HEDGING OF FINANCIAL RISKS AND TRANSACTIONS WITH FINANCIAL ASSETS USING DERIVATIVES.*
 9. *ORGANISATION AND FUNCTIONING OF RISK MANAGEMENT SYSTEMS IN BANKS OF UKRAINE.*
 10. *INSURANCE OF FINANCIAL RISKS.*
 11. *CONTROL*
- Translated with DeepL.com (free version)*
13. **Recommended editions:**
 1. *Borovyk M.V. Risk management: lecture notes. Kharkiv. National University of Urban Economy named after O.M. Beketov. Kharkiv: KhNUME named after O.M. Beketov, 2018. 65 c.*
 2. *Demchenko G.V. Risk management: lecture notes for students of speciality 073 "Management" of the first bachelor's degree. Kharkiv: KhNUE named after S. Kuznets, 2021. 74 c.*
 3. *Dolinsky L. B. Financial risk management: study guide. Kyiv: National University of Kyiv-Mohyla Academy, 2022. 132 c.*
 4. *Laktionova OA. Financial risk management: a textbook. Vinnytsia: Vasyl' Stus DonNU, 2020. 256 c.*
 14. **Planned types of educational activities and teaching methods:** *26 hours lectures, 1 hours.6 practical classes 78 hours. independent work. Total - 120 hours. Methods of teaching: interactive lectures, elements of problem lecture, individual tasks, introduction of case-methods, using multimedia tools.*
 15. **Form and assessment criteria:**

The assessment is carried out on a 100-point scale.

Final control: test at the end of the 2-nd semester.

Current control (100 points): testing, survey, performance of independent work.
 16. **Language of teaching:** *Ukrainian.*