

Міністерство освіти і науки України
Харківський національний університет імені В. Н. Каразіна
Кафедра міжнародного бізнесу та економічної теорії

«ЗАТВЕРДЖУЮ»

В. о. декана факультету міжнародних
економічних відносин та туристичного
бізнесу



Т. М. Мірошніченко

2023 р.

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ
УПРАВЛІННЯ ФІНАНСОВИМИ РИЗИКАМИ
(назва навчальної дисципліни)

рівень вищої освіти	перший (бакалаврський)
галузь знань	29 «Міжнародні відносини» (шифр і назва)
спеціальність	292 «Міжнародні економічні відносини» (шифр і назва)
освітня програма	«Міжнародні фінанси» (шифр і назва)
спеціалізація	«Міжнародні фінанси» (шифр і назва)
вид дисципліни	за вибором (обов'язкова / за вибором)
факультет	Міжнародних економічних відносин та туристичного бізнесу

2023 / 2024 навчальний рік

Програму рекомендовано до затвердження вченою радою факультету міжнародних економічних відносин та туристичного бізнесу

“ 29” серпня 2023 року, протокол № 1

РОЗРОБНИКИ ПРОГРАМИ:

Чемчикаленко Р. А. – к.е.н., доцент, доцент закладу вищої освіти кафедри міжнародного бізнесу та економічної теорії

Програму схвалено на засіданні кафедри міжнародного бізнесу та економічної теорії

Протокол від “29” серпня 2023 року № 1

В. о. завідувача кафедри _____



(підпис)

Ірина ДЕРІД
(прізвище та ініціали)

Програму погоджено з гарантом освітньої (професійної/наукової) програми (керівником проектної групи) «Міжнародні фінанси» першого (бакалаврського) рівня вищої освіти

назва освітньої програми

Гарант освітньої (професійної/наукової) програми (керівник проектної групи) _____



(підпис)

Ірина ШКОДИНА
(прізвище та ініціали)

Програму погоджено науково-методичною комісією

міжнародних економічних відносин та туристичного бізнесу
назва факультету, для здобувачів вищої освіти якого викладається навчальна дисципліна

Протокол від “29” серпня 2023 року № 1

Голова науково-методичної комісії _____



(підпис)

Лариса ГРИГОРОВА-БЕРЕНДА
(прізвище та ініціали)

ВСТУП

Програма навчальної дисципліни «Управління фінансовими ризиками» складена відповідно до освітньо-професійної (освітньо-наукової) програми підготовки

першого (бакалаврського) рівня
(назва рівня вищої освіти)

спеціальності 292 «Міжнародні економічні відносини»

спеціалізації

«Міжнародні фінанси»

1. Опис навчальної дисципліни

1.1. Мета викладання навчальної дисципліни «Управління фінансовими ризиками» полягає в оволодінні студентами системою знань з теорії, методології й методики управління фінансовими ризиками, а також закріплення набутих знань під час розв'язання практичних завдань й ситуацій.

1.2. Основні завдання вивчення дисципліни «Управління фінансовими ризиками» є:

- формування наступних загальних компетентностей:

ЗК3. Здатність навчатися та бути сучасно навченим.

ЗК5. Здатність спілкуватися державною мовою як усно, так і письмово.

ЗК8. Здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу.

ЗК9. Уміння бути критичним та самокритичним.

ЗК10. Здатність спілкуватися з представниками інших професійних груп різного рівня (з експертами з інших галузей знань/видів економічної діяльності).

ЗК12. Знання та розуміння предметної області та розуміння професійної діяльності.

- формування наступних фахових компетентностей:

ФК3. Здатність виявляти особливості функціонування середовища міжнародних економічних відносин та моделей економічного розвитку.

ФК5. Здатність здійснювати комплексний аналіз та моніторинг кон'юнктури світових ринків, оцінювати зміни міжнародного середовища та вміти адаптуватися до них

ФК6. Здатність аналізувати міжнародні ринки товарів і послуг, інструменти та принципи регулювання міжнародної торгівлі.

ФК7. Здатність аналізувати теорії та механізми реалізації міжнародних валютно-фінансових і кредитних відносин

ФК9. Здатність до діагностики стану досліджень міжнародних економічних відносин та світового господарства у міждисциплінарному поєднанні із політичними, юридичними, природничими науками

ФК14. Здатність спілкуватися на професійному та соціальному рівнях з використанням фахової термінології, включаючи усну і письмову комунікацію державною та іноземними мовами.

ФК16. Здатність постійно підвищувати теоретичний рівень знань, генерувати й ефективно використовувати їх в практичній діяльності.

ФК17. Здатність розуміти технології прийняття рішень в області міжнародних фінансів, використовувати набуті теоретичні знання для розробки ефективних стратегій та тактик поведінки суб'єктів господарювання в складному міжнародному фінансовому середовищі.

ФК 18. Здатність оцінювати ризики в міжнародній фінансовій діяльності та управляти ними; використовувати сучасні механізми забезпечення фінансової безпеки суб'єктів

господарювання.

ФК 20. Здатність використовувати базові знання й практичні навички у сфері монетарного, фіскального регулювання та регулювання міжнародного фінансового ринку.

1.3. Кількість кредитів – 3.

1.4. Загальна кількість годин – 90 год.

1.5. Характеристика навчальної дисципліни	
Обов'язкова / за вибором	
Денна форма навчання	Заочна (дистанційна) форма навчання
Рік підготовки	
4-й	-й
Семестр	
7-й	-й
Лекції	
32 год.	год.
Практичні, семінарські заняття	
16 год.	год.
Лабораторні заняття	
0 - год.	год.
Самостійна робота	
42 год.	год.
у тому числі контрольна робота	
5 год.	

1.6. Заплановані результати навчання

Згідно з вимогами освітньо-професійної програми студенти мають досягти наступних результатів:

ПРН1. Відповідально ставитися до професійного самовдосконалення, усвідомлюючи необхідність навчання впродовж усього життя, проявляти толерантність та готовність до інноваційних змін.

ПРН2. Вільно спілкуватися з професійних питань державною та іноземними мовами усно і письмово, фахово використовувати економічну термінологію.

ПРН7. Застосовувати набуті теоретичні знання для розв'язання практичних завдань та змістовно інтерпретувати отримані результати.

ПРН9. Розуміти і вміти застосовувати, відповідно до інших вимог освітньої програми, сучасні теорії та методи розв'язання спеціалізованих складних задач і практичних проблем у сфері міжнародної торгівлі товарами та послугами, міжнародного руху капіталу, міжнародних валютно-фінансових та кредитних відносин, мобільності людських ресурсів, міжнародного трансферу технологій.

ПРН10. Ідентифікувати та виокремлювати особливості функціонування суб'єктів міжнародних відносин та моделей їх економічного розвитку.

ПРН14. Розуміти і застосовувати теорії, принципи, засоби й інструменти реалізації міжнародних валютно-фінансових та кредитних відносин.

ПРН18. Досліджувати економічні явища та процеси у міжнародній сфері на основі розуміння категорій, законів; виділяючи й узагальнюючи тенденції, закономірності функціонування та розвитку світового господарства з урахуванням причинно-наслідкових та просторово-часових зв'язків.

ПРН20. Відстоювати національні інтереси України з урахуванням безпекової компоненти міжнародних економічних відносин.

ПРН 22. Застосовувати відповідні методи, правила і принципи функціонування міжнародних економічних відносин для розвитку зовнішньоекономічної діяльності України.

ПРН23. Усвідомлювати необхідність навчання впродовж життя з метою підтримки професійної

компетентності на високому рівні.

ПРН25. Презентувати результати дослідження на базі яких, розробляються рекомендації та заходи з адаптації до змін міжнародного середовища.

ПРН28. Знати особливості здійснення міжнародної фінансової, операційної та інвестиційної діяльності суб'єктів господарювання, знання методів оптимізації фінансової діяльності суб'єктів господарювання на міжнародному ринку.

ПРН29 Уміти використовувати сучасні методи управління корпоративними фінансами для вирішення стратегічних завдань учасників міжнародних економічних відносин.

ПРН30. Аналізувати сучасний стан фінансової системи України та шляхи її інтеграції в міжнародну фінансову систему.

2. Тематичний план навчальної дисципліни

Розділ 1. Теоретико-методологічні підходи до сутності ризику як економічної категорії та його якісної та кількісної оцінки

Тема 1. Ризик як економічна категорія. Невизначеність та ризик.

Проблема ризику в економічній думці. Сутність та характерні ознаки ризику. Об'єктивна та суб'єктивна концепції ризику. Об'єкт та суб'єкт ризику. Функції та джерела ризику. Аксиоми ризикології. Сутність понять «невизначеність» та «ймовірність». Види втрат в умовах невизначеності й ризику. Аналіз та оцінка причин виникнення й джерел невизначеності в конкурентному середовищі. Роль ризику невизначеності в функціонуванні і стратегічному управлінні розвитком підприємств в конкурентному середовищі.

Тема 2. Диверсифікація ризику при прийнятті рішень на різних рівнях економічного управління

Принципи класифікації ризиків. Ризики організації. Транспортний ризик. Фактори, що впливають на транспортний ризик.

Тема 3. Фінансові ризики: сутність та передумови управління

Передумови актуалізації управління фінансовими ризиками. Сутність і види фінансових ризиків, сфери їх прояву. Основні підходи та принципи управління фінансовими ризиками. Суб'єкти управління фінансовими ризиками та їх функції.

Тема 4. Основи оцінки фінансових ризиків

Загальні підходи до кількісної оцінки фінансових ризиків. Показники оцінки фінансових ризиків. Врахування ступеня схильності до ризику. Функція корисності.

Тема 5. Фінансові кризи і крахи – виникнення та можливість їх прогнозування

Основні тенденції світової фінансової системи. Фінансові кризи світових фінансових ринків та їх чинники. Основні передумови виникнення фінансових криз. Основні чинники виникнення фінансових криз на фінансових ринках та їх наслідки. Вплив кризи в банківській системі США на світовий фінансовий ринок. Взаємозалежність стану економік країн світу та фінансових ринків. Методи аналізу та прогнозування фінансових ринків та їх критична оцінка. Крахи як наслідки фінансових криз та чому щодо них необхідно непокоїтися. Зворотні зв'язки та самоорганізація в економіці. Моделювання фінансових “бульбашок” та ринкових крахів. Напрями розвитку методів прогнозування критичних подій на фінансових ринках. Співпраця урядів та центробанків щодо переборювання світової фінансової кризи 2008–2010 рр. Вплив світової фінансової кризи на фінансовий ринок України та її основні наслідки. Криза в Україні 2014–2017 рр. або криза “двох інтервенцій”. Напрями розвитку світової фінансової теорії у формуванні та побудові систем прогнозування кризових явищ у фінансових системах. Міжнародна система моніторингу фінансових криз. Адміністративні заходи світової фінансової спільноти щодо моніторингу і попередження кризових явищ.

Розділ 2. Практичні аспекти управління фінансовими ризиками

Тема 6. Управління кредитним ризиком

Сутність і види кредитного ризику. Методичні підходи до оцінки кредитного ризику позичальника і управління ним. Оцінка та управління кредитним ризиком нефінансовими корпораціями. Використання кредитних деривативів у практиці управління кредитним ризиком.

Тема 7. Управління валютним ризиком

Види валютного ризику і фактори його визначення. Методи управління валютним ризиком. Методи управління валютним ризиком на основі хеджування.

Тема 8. Управління процентним ризиком

Сутність процентного ризику і його детермінанти. Основні методи управління процентним ризиком. Інструменти хеджування процентного ризику.

Тема 9. Управління ринковим ризиком

Ціни та індекси цін фінансових інструментів як об'єкти впливу ринкового ризику. Показники оцінки ринкового ризику для пайових і боргових фінансових інструментів. Портфельний підхід до управління ринковим ризиком. Хеджування ринкового ризику.

3. Структура навчальної дисципліни

Назви розділів і тем	Кількість годин											
	денна форма						заочна форма					
	усього	у тому числі					усього	у тому числі				
		л	п	лаб.	інд.	с. р.		л	п	лаб.	інд.	с. р.
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Розділ 1. Теоретико-методологічні підходи до сутності ризику як економічної категорії та його якісної та кількісної оцінки												
Тема 1. Ризик як економічна категорія. Невизначеність та ризик	11	6	2			3						
Тема 2. Диверсифікація ризику при прийнятті рішень на різних рівнях економічного управління	5	2				3						
Тема 3. Фінансові ризику: сутність та передумови управління	7	2	2			3						
Тема 4. Основи оцінки фінансових ризиків	11	4	4			3						
Тема 5. Фінансові кризи і крахи – виникнення та можливість їх прогнозування	5	2				3						
Разом за розділом 1	39	16	8	0	0	15						
Розділ 2. Практичні аспекти управління фінансовими ризиками												
Тема 6. Управління кредитним ризиком	9	4	2			3						
Тема 7. Управління валютним ризиком	9	4	2			3						
Тема 8. Управління процентним ризиком	9	4	2			3						

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Тема 9. Управління ринковим ризиком	9	4	2			3						
Індивідуальне завдання - контрольна робота	5					5						
Екзамен (підготовка)	10					10						
Разом за розділом 2	51	16	8	0	0	27						
Усього годин	90	32	16	0	0	42						

4. Теми семінарських (практичних, лабораторних) занять

№ з/п	Назва теми	Кількість годин
1.	Ризик та невизначеність у ринковій економіці. Види економічних ризиків. Види втрат в умовах невизначеності та ризику	2
2.	Моделювання економічного ризику на базі концепції теорії гри. Приклади розв'язання задач із використанням мінімаксного критерію, критерію Байєса-Лапласа, критерію Севіджа, Ходжа-Лемана, Гурвіца та Гермейєра	2
3.	Системний підхід до аналізу ризику. Кількісний аналіз ризику	2
4.	Застосування теорії корисності в ризик-менеджменті	2
5.	Мінімізація ризиків при формуванні структури капіталу бізнесу як елемент системи управління кредитним ризиком	2
6.	Управління валютним ризиком	2
7.	Управління процентним ризиком	2
8.	Управління ринковим ризиком	2
	Разом	16

5. Завдання для самостійної роботи

№ з/п	Види, зміст самостійної роботи	Кількість годин
1	2	3
1.	Підготуватися за рекомендованою літературою до питань, винесених на семінарське заняття за темою 1 «Ризик як економічна категорія. Невизначеність та ризик». Прочитати рекомендовані літературні джерела.	3
2.	Підготуватися за рекомендованою літературою до питань, винесених на практичне заняття за темою 2 «Диверсифікація ризику при прийнятті рішень на різних рівнях економічного управління». Прочитати рекомендовані літературні джерела. Самостійно доповнити конспект лекцій.	3
3.	Підготуватися за рекомендованою літературою до питань, винесених на практичне заняття за темою 3 «Фінансові ризики: сутність та передумови управління». Прочитати рекомендовані літературні джерела. Прочитати рекомендовані літературні джерела. Самостійно доповнити конспект лекцій.	3
4.	Підготуватися за рекомендованою літературою до питань, винесених на практичне заняття за темою 4 «Основи оцінки фінансових ризиків». Прочитати рекомендовані літературні джерела. Підготуватися до виконання розрахункових та тестових завдань.	3

1	2	3
5.	Підготуватися за рекомендованою літературою до питань, винесених на практичне заняття за темою 5 «Фінансові кризи і крахи – виникнення та можливість їх прогнозування». Прочитати рекомендовані літературні джерела. Підготувати есе на тему «Світові фінансові кризи: причини виникнення та їх наслідки»	3
6.	Підготуватися за рекомендованою літературою до питань, винесених на практичне заняття за темою 6 «Управління кредитним ризиком». Прочитати рекомендовані літературні джерела. Підготуватися до виконання розрахункових та тестових завдань.	3
7.	Підготуватися за рекомендованою літературою до питань, винесених на практичне заняття за темою 7 «Управління валютним ризиком». Прочитати рекомендовані літературні джерела. Самостійно доповнити конспект лекцій.	3
8.	Підготуватися за рекомендованою літературою до питань, винесених на практичне заняття за темою 8 «Управління процентним ризиком». Прочитати рекомендовані літературні джерела. Самостійно доповнити конспект лекцій.	3
9.	Підготуватися за рекомендованою літературою до питань, винесених на практичне заняття за темою 9 «Управління ринковим ризиком». Прочитати рекомендовані літературні джерела. Підготуватися до виконання розрахункових та тестових завдань.	3
10.	Підготовка контрольної роботи – індивідуального завдання	5
11.	Підготовка до заліку	10
	Разом	42

6. Індивідуальні завдання

Індивідуальне завдання з дисципліни «Управління фінансовими ризиками» є контрольна робота.

Мета контрольної роботи є формування у студентів системи знань з дисципліни «Управління фінансовими ризиками», основою яких є набуття практичних навичок щодо управління фінансовими ризиками бізнес-структур.

У ході виконання запропонованих завдань передбачається відповідь на тестові питання та виконання практичних завдань відповідно до запропонованого варіанту контрольної роботи.

Детальні вимоги до змісту, критерії оцінювання та оформлення контрольної роботи наведені в НМКД дисципліни «Управління фінансовими ризиками».

7. Методи навчання

Під час викладання дисципліни «Управління фінансовими ризиками» використовуються три групи методів :

словесні – розповідь, пояснення, бесіда, лекція, дискусія, робота з книгою – при опануванні здобувачами вищої освіти теоретичного матеріалу, визначенні дискусійних питань, встановленні переваг та недоліків використання тих чи інших інформаційних систем і технологій;

наочні – демонстрація реальних інформаційних систем і технологій у фінансах, що можуть використовуватися здобувачами вищої освіти під час виконання ним фахових завдань в практичній діяльності, ілюстрація запропонованого матеріалу схемами, графіками, мультимедійними презентаціями – для візуалізації запропонованого теоретичного матеріалу;

практичні – розв’язання практичних задач та кейсів – для формування вмінь і навичок, логічного завершення ланки пізнавального процесу стосовно конкретної теми, розділу навчальної дисципліни.

Таблиця 7.1

Методи навчання та засоби діагностики результатів навчання за освітньою компонентною «Управління фінансовими ризиками»

Шифр ПРН (відповідно до ОНП)	Результати навчання (відповідно до ОПП)	Методи навчання	Засоби діагностики / форми оцінювання
1	2	3	4
ПРН1.	Відповідально ставитися до професійного самовдосконалення, усвідомлюючи необхідність навчання впродовж усього життя, проявляти толерантність та готовність до інноваційних змін.	Бесіда, пояснення, розповідь, робота з книгою	Оцінювання усних відповідей на семінарських заняттях, презентація
ПРН2.	Вільно спілкуватися з професійних питань державною та іноземними мовами усно і письмово, фахово використовувати економічну термінологію.	Бесіда, пояснення, розповідь, робота з книгою	Оцінювання усних відповідей на семінарських заняттях, презентація
ПРН7.	Застосовувати набуті теоретичні знання для розв'язання практичних завдань та змістовно інтерпретувати отримані результати.	Лекція, дискусія щодо доповідей за темами семінарських занять	Оцінювання усних відповідей на семінарських та практичних заняттях, тестів
ПРН9.	Розуміти і вміти застосовувати, відповідно до інших вимог освітньої програми, сучасні теорії та методи розв'язання спеціалізованих складних задач і практичних проблем у сфері міжнародної торгівлі товарами та послугами, міжнародного руху капіталу, міжнародних валютно-фінансових та кредитних відносин, мобільності людських ресурсів, міжнародного трансферу технологій.	Лекція, дискусія щодо доповідей за темами семінарських занять	Оцінювання усних відповідей на семінарських заняттях, тестів
ПРН10.	Ідентифікувати та виокремлювати особливості функціонування суб'єктів міжнародних відносин та моделей їх економічного розвитку.	Дискусія щодо доповідей за темами семінарських занять	Оцінювання усних відповідей на семінарських заняттях, тестів
ПРН14.	Розуміти і застосовувати теорії, принципи, засоби й інструменти реалізації міжнародних валютно-фінансових та кредитних відносин.	Лекція, дискусія щодо доповідей за темами семінарських занять	Оцінювання усних відповідей на семінарських заняттях, тестів

1	2	3	4
ПРН18.	Досліджувати економічні явища та процеси у міжнародній сфері на основі розуміння категорій, законів; виділяючи й узагальнюючи тенденції, закономірності функціонування та розвитку світового господарства з урахуванням причинно-наслідкових та просторово-часових зв'язків.	Лекція, дискусія щодо доповідей за темами семінарських занять	Оцінювання усних відповідей на семінарських заняттях, тестів
ПРН20.	Відстоювати національні інтереси України з урахуванням безпекової компоненти міжнародних економічних відносин.	Лекція, дискусія щодо доповідей за темами семінарських занять	Презентація результатів теоретичних досліджень і виконання практичних завдань
ПРН 22.	Застосовувати відповідні методи, правила і принципи функціонування міжнародних економічних відносин для розвитку зовнішньоекономічної діяльності України.	Лекція, розв'язання практичних задач та кейсів, демонстрація реальних прикладів щодо вирішення практичних завдань	Оцінювання усних відповідей на семінарських заняттях, презентація результатів виконання практичних завдань
ПРН23.	Усвідомлювати необхідність навчання впродовж життя з метою підтримки професійної компетентності на високому рівні.	Бесіда, пояснення, розповідь, робота з книгою	Оцінювання усних відповідей на семінарських заняттях, презентація
ПРН25.	Презентувати результати дослідження на базі яких, розробляються рекомендації та заходи з адаптації до змін міжнародного середовища.	Дискусія, демонстрація реальних ситуацій появи й усунення фінансових ризиків	Презентація результатів виконання практичних завдань
ПРН28.	Знати особливості здійснення міжнародної фінансової, операційної та інвестиційної діяльності суб'єктів господарювання, знання методів оптимізації фінансової діяльності суб'єктів господарювання на міжнародному ринку.	Лекція, розв'язання практичних задач та кейсів, демонстрація реальних прикладів щодо вирішення практичних завдань	Оцінювання усних відповідей на семінарських заняттях, презентація результатів виконання практичних завдань
ПРН29.	Уміти використовувати сучасні методи управління корпоративними фінансами для вирішення стратегічних завдань учасників міжнародних економічних відносин.	Лекція, розв'язання практичних задач та кейсів, демонстрація реальних прикладів щодо вирішення практичних завдань	Оцінювання усних відповідей на семінарських заняттях, презентація результатів виконання практичних завдань

ПРН30.	Аналізувати сучасний стан фінансової системи України та шляхи її інтеграції в міжнародну фінансову систему.	Лекція, розв'язання практичних задач та кейсів, демонстрація реальних прикладів щодо вирішення практичних завдань	Оцінювання усних відповідей на семінарських заняттях, презентація результатів виконання практичних завдань
--------	---	---	--

Замість виконання завдань (вивчення тем) можуть також додатково враховуватись такі види активностей здобувача:

- проходження тренінг-курсів чи дистанційних курсів з використанням сучасних освітніх технологій на платформах Coursera, Prometheus тощо (за наявності відповідного документу про їх закінчення, надання копії викладачу);

- участь в майстер-класах, форумах, конференціях, семінарах, зустрічах з проблем використання сучасних освітніх технологій (з підготовкою статей, тез доповідей, есе, прес-релізу, інформаційного повідомлення тощо, що підтверджено навчальною програмою заходу, публікацією чи відповідним сертифікатом);

- участь у науково-дослідних та прикладних дослідженнях з проблем використання сучасних освітніх технологій (в розробці анкетних форм, проведенні опитувань, підготовці та проведенні фокус-груп, обробці результатів дослідження, підготовці звіту, презентації результатів тощо, що підтверджується демонстрацією відповідних матеріалів).

8. Методи контролю

Методами контролю з дисципліни «Управління фінансовими ризиками» є поточний та підсумковий контроль. Поточний контроль здійснюється під час проведення лекційних та практичних занять і має на меті перевірку рівня підготовленості студента до виконання конкретної роботи. Формами проведення поточного контролю з дисципліни є:

- усний контроль, що по своїй сутності передбачає діалог і перевірку репродуктивного відтворення студентом отриманої та самостійно знайденої інформації;

- дискусія, що передбачає активний диспут між усією групою та викладачем стосовно знаходження відповіді на поставлене питання;

- виконання розрахунково-аналітичних завдань зі сфери майбутньої фахової діяльності з допомогою існуючих інформаційних систем та технологій;

- обговорення наукових статей з тематики практичних занять;

- перевірка виконання письмових завдань, винесених на самостійну роботу студента за темою;

- письмовий контроль у вигляді тестів;

- виконання контрольної роботи;

- підсумковий контроль у вигляді письмового заліку.

9. Схема нарахування балів

Приклад для підсумкового семестрового контролю при проведенні семестрового екзамену або залікової роботи

Поточний контроль, самостійна робота, індивідуальні завдання										Екзамен	Сума			
Розділ 1					Розділ 2					Контрольна робота, передбачена навчальним планом	Індивідуальне завдання	Разом		
T1	T2	T3	T4	T5	T6	T7	T8	T9						
5	5	6	6	6	6	6	5	5	10	-	60	40	100	

T1, T2 ... – теми розділів.

Для допуску до складання підсумкового контролю (заліку, або екзамену) здобувач вищої освіти повинен набрати не менше 10 балів з навчальної дисципліни під час поточного контролю, самостійної роботи, індивідуального завдання.

Критерії оцінювання навчальних досягнень

При вивченні кожного розділу проводиться поточний контроль. На практичному занятті студент може отримати від 1 до 5 балів за різні види завдань (табл. 8.1). Максимально студент може отримати 60 балів в ході лекційних та практичних занять.

Таблиця 9.1

Критерії та методи оцінювання		
Методи	Критерії оцінювання	Система оцінювання, бали
Тестування онлайн	виставляється здобувачу вищої освіти за одне тестове питання у випадку правильної відповіді. За кожною темою, де передбачено тестування, пропонується 10 тестових питань закритого типу та з декількома варіантами відповідей.	0,2
Робота над практичними завданнями	за логічну правильність дій та їх послідовність	1
	за відповідність арифметичних розрахунків еталонній відповіді	1
	за вміння інтерпретувати отримані результати	1-2
Робота над індивідуальним завданням	виставляється здобувачу вищої освіти, який досяг цілей завдання, продемонстрував здатність застосовувати знання на практиці, обґрунтовувати власну думку	0-10

Підсумковий контроль засвоєння розділів здійснюється по їх завершенню на основі проведення екзамену. Завданням контролю є оцінювання знань, умінь та практичних навичок студентів, набутих під час вивчення зазначених тем.

Структура екзамену:

діагностичне завдання (теоретичне питання) – 20 балів (2 теоретичні питання x 10 балів)

тести – 10 балів (5 тестових завдань x 2,0 бали);

практичне завдання – 10 балів.

Критерії оцінювання теоретичне питання:

1. Повнота та відповіді – 5 балів.
2. Знання сучасних пакетів прикладних програм, що вирішують поставлену проблему – 3 бали.
3. Наповненість відповіді прикладами практичного вирішення поставленої проблеми – 2 бали.

Критерії оцінювання практичне завдання:

1. За логічну правильність дій та їх послідовність – 3 бали.
2. За відповідність арифметичних розрахунків еталонній відповіді – 2 бали.
3. За вміння інтерпретувати отримані результати – 5 балів.

Шкала оцінювання

Сума балів за всі види навчальної діяльності протягом семестру	Оцінка	
	для чотирирівневої шкали оцінювання	для дворівневої шкали оцінювання
90 – 100	відмінно	зараховано
70-89	добре	
50-69	задовільно	
1-49	незадовільно	не зараховано

10. Рекомендована література Основна література

1. Шклярук С. Г. Управління фінансовими ризиками: навч. посіб. / С. Г. Шклярук. – Київ : ДП «Вид. дім «Персонал», 2019. – 494 с.
2. Управління фінансовими ризиками : навч. Посібник / П. О. Куцик, Т. Г, Васильців, В. М. Сороківський, В. І. Стефаняк, М. В. Сороківська. – Львів : Растр-7, 2016. – 318 с.
3. Управління ризиками банків: монографія у 2-х томах. Т. 1: Управління ризиками базових банківських операцій / за ред. д-ра екон. наук, проф. А. О. Єпіфанова і д-ра екон. наук, проф. Т. А. Васильєвої. – Суми: ДВНЗ «УАБС НБУ», 2012. – 283 с.
4. Управління фінансовими ризиками: навчально-методичний посібник / за заг. ред. д-ра екон. наук П. В. Єгорова. – Донецьк: Цифрова типографія, 2011. – 226 с.

Допоміжна література

5. Гуменюк В. Я. Управління ризиками: Навч. посіб. / В. Я. Гуменюк, Г. Ю. Міщук, О. О. Олійник. – Рівне : НУВГП, 2009. – 156 с.
6. Едвардес У. Ключові фінансові інструменти: пер. з англ. – К. : Всеуито; Наук. думка, 2003. – 255 с.
7. Матеріали семінару НБУ «Впровадження вимог Положення про організацію системи управління ризиками в банках України та банківських групах (для банків)». URL: https://old.bank.gov.ua/control/uk/publish/article?art_id=79051024& cat_id=77863483
8. Методичні рекомендації з управління ризиками в платіжних системах, 2018. URL: <https://bank.gov.ua/ua/news/all/metodichni-rekomendatsiyi-z-upravlin-nya-rizikami-v-platijnih-sistemah>
9. Benoit B., Mandelbrot, Richard L. Hudson. The (mis) Behavior of Markets. A Fractal View of Risk, Ruin, and Reward. A Member of the Perseus Books Group. – New York, 2004. – 400 p.
10. Engelmann B. The Basel II Risk Parameters Estimation, Validation, Stress Testing – with Applications to Loan Risk Management / B. Engelmann, R. Rauhmeier. – Second Edition. – London, New York : Springer Heidelberg Dordrecht, 2011. – 435 p.

11. Посилання на інформаційні ресурси в Інтернеті, відео-лекції, інше методичне забезпечення

1. <http://intranz.eerc.kiev.ua> – Бібліотека Консорціума економічної освіти та досліджень.
2. <http://www.liga.kiev.ua> – Інформаційно-пошукова система законодавства України.
3. <http://www.nbu.gov.ua> – Національна бібліотека України ім. В.І.Вернадського.
4. <http://www.uin-tei.kiev.ua> – Українська система науково-технічної та економічної інформації.
5. <https://kpmg.com/ua/uk/home/services/consulting/financial-risk-management.html> – Управління фінансовими ризиками KPMG
6. <http://www.imf.org> – Сайт Світового валютного фонду

7. <http://www.bis.org> – Базельський комітет із банківського нагляду (Basel Committee on Banking Supervision).
8. <http://www.ssmc.gov.ua> – Сайт Державної комісії з цінних паперів та фондового ринку.
9. <http://www.ssmc.gov.ua> – Сайт Світової федерації фондових бірж.
10. <http://www.bank.gov.ua> – Сайт Національного банку України.
11. <http://www.pfts.com> – Сайт Першої фонові торгівельної системи.
12. <http://www.ukrstat.gov.ua> – Сайт Державного комітету статистики України.
13. <http://www.worldbank.org> – Сайт Світового банку.

12. Особливості навчання за денною формою в умовах подовження дії обставин непоборної сили

В умовах дії обмежень освітній процес в університеті здійснюється за дистанційною формою навчання, а саме:

– дистанційно (за затвердженим розкладом занять) на платформі Zoom можуть проводитися всі лекційні заняття;

– дистанційно на платформах Moodle та Zoom можуть проводитися практичні (семінарські), індивідуальні заняття та консультації, контроль самостійної роботи, можливе написання контрольної роботи, передбаченої навчальним планом;

Складання підсумкового семестрового контролю: в разі запровадження обмежень з заборонаю відвідування ЗВО студентам денної та заочної форми навчання надається можливість скласти **екзамен дистанційно на платформі Moodle** в дистанційному курсі «Управління фінансовими ризиками» .