

Назва дисципліни	Управління фінансовими ризиками
Інформація про факультети (навчально-наукові інститути) і курси навчання, студентам яких пропонується вивчати цю дисципліну	Факультет МЕН та ТБ, спеціальність 292 «Міжнародні економічні відносини», ОПП «Міжнародні фінанси», 2 курс, 4 семестр
Контактні дані розробників робочої програми навчальної дисципліни, науково-педагогічних працівників, залучених до викладання	<p>Викладання дисципліни забезпечує кафедра міжнародного бізнесу та економічної теорії.</p> <p>Викладач: к.е.н., доцент Соболева М.В.</p> <p>Контакти: ауд. 3-76, 3-78 (Центральний корпус), 057-707-53-51, ec_teor@karazin.ua</p>
Попередні умови для вивчення дисципліни	<p>Попередніми умовам для вивчення дисципліни Управління Фінансовими ризиками є здатність студента вчитися та оволодівати сучасними знаннями, вивчення студентами таких дисциплін як «Основи економічної теорії», «Гроші та кредит», «Мікроекономіка та макроекономіка»</p>
Опис	<p>Мета дисципліни.</p> <p>Послідовне формування у студентів знань, основних положень теорії і практики ризик-менеджменту в сфері фінансових взаємовідносин суб'єктів господарської діяльності. Формування у них системного уявлення про дисципліну, що читається та вироблення навичок прийняття рішень з проблем виявлення та ідентифікації ризиків, способи їх виявлення, попередження, що застосовуються на фінансових ринках як національного, так і міжнародного рівнів.</p> <p>Надається визначення поняття «фінансовий ризик суб'єкта господарювання». Підкреслюється роль страхування в економічному захисті та стабільному розвитку суб'єкта господарювання. Аналізується проблема відсутності необхідного законодавчого регулювання та нормативного забезпечення страхування фінансових ризиків в Україні.</p>

Наводяться види фінансових ризиків, що можуть бути застраховані. Розглядається їх сутність та роль страхування. Надається порівняльна характеристика основних видів програм страхування фінансових ризиків, що представлені в Україні.

В результаті навчання студент має :

- демонструвати правильне розуміння прояву ризику в системі фінансових відносин;
- демонструвати оволодіння теоретичними основами управління фінансовим ризиком, розуміння актуальності теорії управління фінансовими ризиками;
- демонструвати уявлення студентів про класифікацію ризиків та способи їх визначення;
- знати загальні принципи організації ризик-менеджменту
- розглянути і порівняти загальні методи і показники, які застосовуються для оцінки економічних ризиків;
- дати систему показників оцінки фінансових ризиків (ймовірність, очікувана прибутковість, стандартне відхилення, ін.);
- розглянути принципи організації управління фінансовими ризиками;
- охарактеризувати і порівняти підходи та методи управління фінансовими ризиками: лімітування, диверсифікація, страхування, управління активами і пасивами, термінові контракти (ф'ючерси, опціони), інші.
- демонструвати практичні навички з організації ефективного управління фінансовою діяльністю в ризиковому середовищі.

Програмні результати навчання згідно ОПШ:

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.

Володіти навичками самоаналізу (самоконтролю), бути критичним і самокритичним, розуміти детермінанти впливу на спілкування з представниками інших бізнес-культур та

професійних груп різного рівня (з фахівцями з інших галузей знань/видів діяльності) на засадах цінування різноманітності, мультикультурності та поваги до них.

Планувати, організовувати, мотивувати, оцінювати та підвищувати результативність колективної праці, здійснювати дослідження в групі під керівництвом лідера, з урахуванням вимог та особливостей сьогодення в умовах обмеженості часу.

Розробляти та реалізовувати міжнародні проекти, працювати в проектних групах, мотивувати людей і рухатися до спільної мети, діяти соціально-відповідально та свідомо.

Обґрунтовувати власну думку щодо конкретних умов реалізації форм МЕВ на мега-, макро-, мезо- і мікрорівнях.

Розуміти та застосовувати базові знання основних нормативно-правових актів і довідкових матеріалів, чинних стандартів і технічних умов, інструкцій та інших нормативно-розпорядчих документів у сфері міжнародних економічних відносин. Володіти базовими категоріями, новітніми теоріями, концепціями, технологіями та методами у сфері міжнародних економічних відносин з урахуванням їх основних форм, зокрема: міжнародної торгівлі товарами та послугами, міжнародного руху капіталу, міжнародних валютно-фінансових та кредитних відносин, мобільності людських ресурсів, міжнародного трансферу технологій.

Застосовувати базові знання, аналізуючи теорії, принципи, засоби й інструменти реалізації міжнародних валютно-фінансових та кредитних відносин.

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

Застосовувати відповідні методи, правила і принципи функціонування МЕВ для розвитку зовнішньоекономічної діяльності України.

Уміти вирішувати стратегічні проблеми у сфері міжнародних економічних відносин та міжнародних фінансів.

Уміти застосовувати в своїй діяльності стандарти

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

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

Володіти методами аналізу інвестиційних проєктів, поведінки економічних агентів на міжнародних фінансових ринках;

Володіти навичками управління міжнародними інвестиційними портфелями та методами щодо їх оптимізації;

Знати способи формалізації й побудови моделей міжнародної економічної діяльності, технології розробки та реалізації управлінських рішень щодо управління фінансовими ресурсами

Теми аудиторних занять та самостійної роботи

1. Теоретичні основи управління фінансовими ризиками
2. Політико-економічний ризик у системі ризик-менеджменту
3. Хеджування фінансових ризиків на ринку строкових угод
4. Інтеграція страхових організацій та комерційних банків у сфері ризик-менеджменту
5. Управління інвестиційними ризиками
6. Ризик неплатоспроможності суб'єктів господарювання
7. Кредитний ризик в системі фінансових відносин
8. Управління фінансовими ризиками на іпотечному ринку
9. Управління ризиком ліквідності
10. Валютні ризики суб'єктів господарювання, методи аналізу і управління

Методи контролю результатів навчання

- усний контроль, що по своїй сутності передбачає діалог і перевірку репродуктивного відтворення студентом отриманої інформації, а також усний контроль у формі доповіді студентом стосовно проблеми, що не була вирішена в рамках інформації, даної у лекції;

- письмова контрольна робота;

- підсумковий контроль у вигляді письмового заліку.

Мова викладання. Українська