

РОБОЧИЙ ТЕМАТИЧНИЙ ПЛАН
 навчальної дисципліни

ФІНАНСОВИЙ РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТ

Обсяг годин - 105
 з них:
 Аудиторних – 32
 Консультацій – 2
 Самостійна робота – 71

Триместр викладання – IV
 Форма контролю – іспит
 Кредитів за курс – 3,5

Курс знайомить з сучасними підходами щодо ідентифікації та аналізу ризиків, оцінки їх ступеня та ймовірності настання. Розглядаються основні математичні методи та моделі вимірювання різних типів фінансових ризиків та управління ними. На реальних прикладах детально розглядаються та аналізуються ситуації використання різноманітних фінансових інструментів, прийомів фінансового менеджменту для успішного управління ризиками. Особлива увага звертається на інтерпретацію положень Базельського комітету щодо контролю за ризиками у сфері банківської діяльності та пропозицій провідних фінансових аналітиків щодо контролю над ризиками.

РОЗПОДІЛ ОБСЯГУ ГОДИН

№	Найменування тем	Кількість годин		
		Усього	у тому числі	
			аудиторні	самостійні
1.	Методологічні засади управління фінансовими ризиками	11	3	8
2.	Сучасні теорії управління фінансовими ризиками. Ризик і теорія ігор.	11	3	8
3.	Система кількісних оцінок фінансового ризику	12	3	9
4.	Управління ризиками проектного фінансування. Ризик неплатоспроможності суб'єктів господарювання	14	4	10
5.	Кредитний ризик в системі фінансових відносин	12	4	8
6.	Роль фінансових деривативів в системі хеджування фінансових ризиків	15	5	10
7.	Управління ризиками ліквідності. Моделі оцінки кредитоспроможності на основі бухгалтерської звітності. Ринкові методи оцінки ймовірності дефолта.	15	5	10
8.	Інтегрований ризик-менеджмент на рівні підприємства	13	5	8
	Консультація	2	-	-
	Усього	105	32	71

ЛІТЕРАТУРА

1. Бланк И.А. Управление финансовыми рисками. – К.: Ника-Центр, 2005. – 600 с.
2. Камінський А.Б. Економічний ризик та методи його вимірювання: Посібник для студентів економічних спеціальностей вузів. – К.: ІМФ при Київському національному університеті ім. Т.Шевченка, 2002. – 120 с.
3. Камінський А.Б. Моделювання фінансових ризиків. – К.: Видавничо-поліграфічний центр «Київський університет», 2006. – 304 с.
4. Лук'яненко І.Г. Діагностика фінансових криз: аналіз, методи, моделі/ І.Г.Лук'яненко, В.М.Жук, О.В. Неживенко, Р.Б. Семко, І.І.Серпак; за наук.ред. І.Г.Лук'яненко.- Монографія, К.: АГРАР МЕДІА ГРУП, 2011. – 197с.
5. Шарп, У. Инвестиции: Пер. с англ./У. Шарп, Г. Александер, Дж. Бэйли. – М: ИНФРА-М, 2009. – 1024 с.
6. Энциклопедия финансового риск-менеджмента / Под ред. А.А. Лобанова, А.В. Чугунова. – М.: Альпина Паблишер, 2010.

Викладач: д.е.н., проф. А.Б. Камінський

Схвалено кафедрою: протокол № 4 від «20» травня 2016 р.

Завідувач кафедри, д.е.н., професор



І.Г. Лук'яненко