

ФІНАНСОВИЙ РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТ

Кафедра фінансів, банківської справи та страхування
Факультет економіки і підприємництва

Анотація:

Мета курсу (інтегральна компетентність) – здобути теоретично-практичні знання з основ фінансового ризик-менеджменту, оволодіння практикою застосування методів кількісної оцінки фінансового ризику в умовах ринкових відносин та прийняття ефективних управлінських рішень в ситуаціях невизначеності та ризику.

Цілі курсу (програмні компетентності):

- здатність формування вмінь оперувати специфічними управлінськими фінансовими термінами, категоріями та поняттями;
- здатність опанувати історичні засади розвитку теорії і практики менеджменту, ідейних вчень класиків фінансового менеджменту, фундаментальних постулатів та парадигм менеджменту, новітніх прогресивних тенденцій розвитку ризиків в менеджменті та антикризового управління;
- здатність у моделюванні та оптимізації фінансових ризиків;
- здатність організовувати та проводити управлінські дослідження, використовуючи сучасну методологію та інформаційні технології;
- здатність в організації процесу страхування від фінансових ризиків;
- здатність опанувати необхідність, завдання, методами, основні напрями з фінансового ризик-менеджменту;
- здатність застосовувати способи оцінки міри фінансового ризику у відповідному сегменті;
- здатність розкрити зміст механізму виникнення та управління фінансовими ризиками;
- здатність застосовувати основні прийоми при управлінні фінансовими ризиками;
- здатність формування класифікації ризиків у фінансово-кредитному сегменті;
- здатність виявляти та розуміти причинно-наслідкові зв'язки між економічними явищами та процесами у сфері ризик-менеджменту, ідентифікувати та оцінювати фактори впливу;
- здатність прийняття ефективних рішень в ситуаціях невизначеності та ризику.

Програмні результати навчання:

- демонструвати знання з основ теорії ризик-менеджменту та практичного її використання в великих економічних системах в умовах невизначеності та ризику;
- уміння застосовувати одержані знання з різних предметних сфер фінансового ризик-менеджменту для формулювання нових теоретичних трактувань і положень, практичних адресних рекомендацій і пропозицій;

– формувати і аналізувати фінансово-статистичну звітність банківських установ та правильно інтерпретувати отриману інформацію;

– ґрунтовні знання класичного та сучасного наукового інструментарію дослідження соціально-економічних явищ та процесів у різних фінансових сферах;

– ідентифікувати джерела та розуміти методологію визначення і методи отримання фінансово-економічних даних, збирати та аналізувати необхідну статистичну інформацію, розраховувати показники у системі ризик-менеджменту в банках;

– демонструвати ґрунтовні знання особливостей, інструментарію, новітніх напрямків менеджменту персоналу та здатність формувати ефективну сучасну систему фінансових ризиків в менеджменті.

Короткий зміст курсу:

Теоретичні основи ризик-менеджменту. Поняття ризику. Прийняття оптимальних рішень в умовах невизначеності. Ризик-менеджмент у сфері фінансів. Фінансовий ризик-менеджмент. Організація та функціонування систем ризик-менеджменту в банках України.