

# УПРАВЛІННЯ ФІНАНСОВИМИ РИЗИКАМИ

**Кафедра фінансів, банківської справи та страхування  
Факультет економіки і підприємництва**

## **Анотація:**

**Мета курсу (інтегральна компетентність)** – формування системи знань щодо організації бізнес-процесів з управління фінансовими ризиками, навичок застосування теоретичних концепцій фінансового управління, здатність розв'язувати складні спеціалізовані завдання та практичні проблеми в ході професійної діяльності або у процесі навчання, що передбачає застосування окремих методів і положень фінансової науки та характеризується невизначеністю умов і необхідністю врахування комплексу вимог здійснення професійної та навчальної діяльності.

## **Цілі курсу (програмні компетентності):**

- здатність до опанування, аналізу виникнення фінансових ризиків та управління ними;
- здатність застосовувати знання під час управління інвестиційними ризиками; ризиками неплатоспроможності суб'єктів господарювання; кредитних ризиків у системі фінансових відносин та ризиками в банківській діяльності; відсотковими ризиками; управління ризиком ліквідності; валютними ризиками суб'єктів господарювання; хеджуванням фінансових ризиків на ринку строкових угод;
- здатність використання інформаційних та комунікаційних технологій в процесі управління фінансовими ризиками;
- здатність до проведення досліджень як на теоретичному, так і на практичному рівні під час управління фінансовими ризиками;
- здатність до оволодіння сучасними знаннями з управління фінансовими ризиками;
- здатність до пошуку, оброблення та аналізу інформації з різних джерел щодо управління фінансовими ризиками;
- здатність працювати у команді під час вирішення питань щодо управління фінансовими ризиками;
- здатність спілкуватися з представниками інвестиційних компаній, суб'єктів господарювання, фінансових установ та ін.;
- здатність формувати специфіку здійснення управління фінансовими ризиками;
- здатність опанувати мету, завдання, основні напрями управління фінансовими ризиками;
- здатність визначати, обґрунтовувати та брати відповідальність за професійні рішення;
- здатність визначати види інструментів управління фінансовими ризиками і їх роль, а також механізм їх застосування;
- уміння вирішувати практичні завдання та ситуації щодо управління фінансовими ризиками.

## **Програмні результати навчання:**

- демонструвати знання з методології аналізу та управління фінансовими ризиками в діяльності суб'єктів господарювання різних організаційно-правових форм та форм власності;
- розуміння сутності, структури, функції та особливостей функціонування механізму ризик-менеджменту у промисловій, банківській, бюджетній та податкових сферах;
- вміння визначати й аналізувати ризики, що притаманні фінансово-економічній діяльності суб'єктів господарювання та забезпечувати їх безпеку та ризикозахищеність;
- обирати оптимальну стратегію розвитку з урахуванням прийнятного рівня ризику;
- здійснювати адаптацію та модифікацію існуючих наукових підходів і методів до конкретних ситуацій професійної діяльності;
- вміти застосовувати інноваційні підходи у сфері фінансів, банківської справи та страхування та управляти ними;
- застосовувати управлінські навички щодо управління фінансовими ризиками;
- здійснювати діагностику і моделювання фінансової діяльності суб'єктів господарювання;
- обґрунтувати вибір варіантів управлінських рішень щодо управління фінансовими ризиками та оцінювати їх ефективність з урахуванням цілей, наявних обмежень, законодавчих та етичних аспектів;
- оцінювати ступінь складності завдань при плануванні діяльності та опрацюванні її результатів.
- визначати роль фінансових інструментів у зниженні фінансових ризиків інвесторів;
- аналізувати процеси, що відбуваються на фінансових ринках та їх вплив на діяльність компаній.

### **Короткий зміст курсу:**

Теоретичні основи управління фінансовими ризиками. Управління інвестиційними ризиками. Ризик неплатоспроможності суб'єктів господарювання. Кредитний ризик у системі фінансових відносин. Особливості управління фінансовими ризиками в банківській діяльності. Відсотковий ризик: методи аналізу та управління. Управління ризиком ліквідності. Валютні ризики суб'єктів господарювання: методи аналізу та управління. Хеджування фінансових ризиків на ринку строкових угод.