СИЛАБУС ДИСЦИПЛІНИ
«Фінансові ризики корпорацій»

Ступінь вищої освіти - Бакалавр
Спеціальність 072 «Фінанси, банківська справа і страхування»
Освітня програма «Корпоративні фінанси»
Рік навчання 4, семестр 8
Форма навчання денна (денна, заочна)
Кількість кредитів ЄКТС 5
Мова викладання українська (українська, англійська, німецька)

Лектор курсу	к.е.н., доцент, Стороженко Оксана Олександрівна
Контактна інформація лектора (e-mail)	кафедра фінансів (044) 527-88-90 9650120@ukr/net
Сторінка курсу в eLearn	

ОПИС ДИСЦИПЛІНИ

Метою викладання даної навчальної дисципліни є формування у студентів компетентностей щодо використання системи знань з управління фінансами корпорацій, визначення стратегії і тактики фінансового забезпечення корпорацій, набуття необхідної сукупності теоретичних і практичних знань, вмінь та навичок для використання технологій та інструментарію фінансового управління корпораціями. Для досягнення мети поставлені такі основні завдання: дослідити теоретичні основи організації фінансів корпорацій та реалізації фінансового менеджменту; оволодіти вмінням використання знань щодо основ організації фінансів корпорацій та реалізації фінансового менеджменту в умовах практичної діяльності або у процесі навчання для ефективного формування, розподілення та управління фінансовими ресурсами корпорацій на основі результатів аналізу та планування з метою формування оптимальних стратегічних і тактичних напрямів їх функціонування.

Набуття компетентностей:

інтегральна компетентність (ІК): здатність розв'язувати складні спеціалізовані завдання та практичні проблеми у галузі фінансів, банківської справи та страхування 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.

загальні компетентності (ЗК):

ЗК02. Здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях.

ЗК07. Здатність вчитися і оволодівати сучасними знаннями.

спеціальні (фахові) компетентності (СК):

СК05. Здатність застосовувати знання законодавства у сфері монетарного, фіскального регулювання та регулювання фінансового ринку.

СК08. Здатність виконувати контрольні функції у сфері фінансів, банківської справи та страхування.

Програмні результати навчання (ПРН):

ПР01. Знати та розуміти економічні категорії, закони, причинно-наслідкові та функціональні зв'язки, які існують між процесами та явищами на різних рівнях економічних систем.

ПР03. Визначати особливості функціонування сучасних світових та національних фінансових систем та їх структури.

ПР04. Знати механізм функціонування державних фінансів, у т.ч. бюджетної та податкової систем, фінансів суб'єктів господарювання, фінансів домогосподарств, фінансових ринків, банківської системи та страхування.

ПР07. Розуміти принципи, методи та інструменти державного та ринкового регулювання діяльності в сфері фінансів, банківської справи та страхування.

ПР10. Ідентифікувати джерела та розуміти методологію визначення і методи отримання економічних даних, збирати та аналізувати необхідну фінансову інформацію, розраховувати показники, що характеризують стан фінансових систем.

ПР11. Володіти методичним інструментарієм здійснення контрольних функцій у сфері фінансів, банківської справи та страхування.
ПР12. Використовувати професійну аргументацію для донесення інформації, ідей, проблем та способів їх вирішення до фахівців і нефахівців у фінансовій сфері діяльності.
ПР13. Володіти загальнонауковими та спеціальними методами дослідження фінансових процесів.
ПР14. Вміти абстрактно мислити, застосовувати аналіз та синтез для виявлення ключових характеристик фінансових систем, а також особливостей поведінки їх суб'єктів.
ПР16. Застосовувати набуті теоретичні знання для розв'язання практичних завдань та змістовно інтерпретувати отримані результати.
ПР18. Демонструвати базові навички креативного та критичного мислення у дослідженнях та професійному спілкуванні.
ПР21. Розуміти вимоги до діяльності за спеціальністю, зумовлені необхідністю забезпечення сталого розвитку України, її зміцнення як демократичної, соціальної, правової держави.
ПР22. Знати свої права і обов'язки як члена суспільства, розуміти цінності вільного демократичного суспільства, верховенства права, прав і свобод людини і громадянина в Україні.
ПР24. Знати і вміти застосовувати на практиці методи та інструменти ідентифікації та розв'язання проблем в сфері корпоративних фінансів .
ПР25. Виявляти резерви підвищення ефективності управління корпоративними фінансами підприємства.

СТРУКТУРА КУРСУ

Тема	Години (лекції/ практичні)	Результати навчання	Завдання	Оцінювання
Тема 1. Сутність і види фінансових ризиків корпорацій	3/3	**Знати** місце фінансових ризиків у системі економічної безпеки корпорацій **Вміти** опрацьовувати нормативно-правові документи з питань фінансових ризиків **Аналізувати** ризики та загрози **Розуміти** структуру фінансової безпеки, взаємозв'язок складових і рівнів економічної безпеки.	Тестові завдання Виконання самостійної роботи (в.т.ч. в elearn) Розв'язок задач. Бізнес кейси	Виконання завдань та практичних робіт – зараховано. Модульна тестова робота в elearn.
Тема 2. Основи оцінки фінансових ризиків	4/4	**Знати** методи оцінки фінансових ризиків та їх попередження **Вміти** використовувати державні соціальні гарантії та стандарти для визначення особистої фінансової безпеки **Аналізувати** диференціацію доходів, соціальну поляризацію, маргіналізацію суспільства та їх вплив на фінансову безпеку держави. соціальні **Розуміти** ступінь впливу конкретних ризиків та загроз на фінансову безпеку людини	Доповіді та колективні презентації	Самостійна робота – згідно з журналом оцінювання в elearn
Тема 3. Кредитний ризик	4/4	**Знати** критерії оцінки кредитного ризику корпорації **Вміти** діагностувати стан підприємства відповідно до існуючих кредитних ризиків та загроз **Аналізувати** результативність управлінських рішень щодо виявлення та попередження кредитних ризиків **Розуміти** необхідність проведення фінансової санації для забезпечення кредитної безпеки підприємства	Доповіді та колективні презентації	Самостійна робота – згідно з журналом оцінювання в elearn

Тема 4. Валютний ризик	4/4	**Знати** сутність валютного ризику як критерія ефективності валютної політики корпорації, критерії та індикатори **Вміти** визначати згідно методики рівень валютного ризику корпорації **Аналізувати** індикатори валютного ризику корпорації	Тестові завдання Виконання самостійної роботи (в.т.ч. в elearn) Розв'язок задач, Бізнес кейси Доповіді та колективні презентації	Виконання завдань та практичних робіт – зараховано. Модульна тестова робота в elearn. Самостійна робота – згідно з журналом оцінювання в elearn
Тема 5. Процентний ризик	4/4	**Знати** критерії оцінювання процентного ризику корпорацій **Вміти** визначати ризики та загрози процентній безпеці корпорацій та визначати її рівень **Розуміти** вплив процентної безпеки на фінансову безпеку корпорацій		
Тема 6. Ринковий ризик	4/4	**Знати** критерії та систему індикаторів оцінки ринкової безпеки корпорацій **Вміти** розраховувати та аналізувати індикатори ринкової безпеки корпорацій **Розуміти** причини виникнення внутрішніх та зовнішніх загроз Ринкового ризику корпорацій		
Тема 7. Соціальний ризик	3/3	**Знати** державні методи забезпечення соціальних стандартів **Вміти** використовувати державні соціальні гарантії та стандарти для визначення особистої фінансової безпеки **Аналізувати** диференціацію доходів, соціальну поляризацію, маргіналізацію суспільства та їх вплив на фінансову безпеку держави. соціальні **Розуміти** ступінь впливу конкретних ризиків та загроз на фінансову безпеку людини		
Тема 8. Фінансова безпека корпорацій	4/4	**Знати** критерії оцінки фінансової безпеки підприємства. **Вміти** діагностувати стан підприємства відповідно до існуючих ризиків та загроз фінансовій безпеці **Аналізувати** результативність управлінських рішень **Розуміти** необхідність проведення фінансової санації для забезпечення фінансової безпеки підприємства		
Всього за семестр				**70**
Екзамен				**30**
Всього за курс				**100**

ПОЛІТИКА ОЦІНЮВАННЯ

Політика щодо дедлайнів та перескладання:	Роботи, які здаються із порушенням термінів без поважних причин, оцінюються на нижчу оцінку. Перескладання модулів відбувається із дозволу лектора за наявності поважних причин (наприклад, лікарняний).
Політика щодо академічної доброчесності:	Списування під час контрольних робіт та екзаменів заборонені (в т.ч. із використанням мобільних девайсів). Курсові роботи, реферати повинні мати коректні текстові посилання на використану літературу
Політика щодо відвідування:	Відвідування занять є обов'язковим. За об'єктивних причин (наприклад, хвороба, міжнародне стажування) навчання може відбуватись індивідуально (в онлайн формі за погодженням із деканом факультету)

ШКАЛА ОЦІНЮВАННЯ СТУДЕНТІВ

Рейтинг здобувача вищої освіти, бали	**Оцінка національна за результати складання екзаменів заліків**	
	екзаменів	**заліків**
90-	відмінно	зараховано
74-89	добре	
60-73	задовільно	
0-59	незадовільно	не зараховано

Рекомендовані джерела інформації

1. Барановський О. І. Сутність і різновиди фінансових криз. *Фінанси України.* 2009.
   № 5. С. 3–20.
2. Вітлінський В. В., Великоіваненко Г. І. Ризикологія в економіці та підприємництві: монографія. К.: КНЕУ, 2004. 460 с.
3. Гусак Д. В. Збірник задач з теорії випадкових процесів та її застосувань у фінансовій математиці та теорії ризику. Київський національний ун-т ім. Тараса Шевченка. К: ВПЦ «Київський ун-т», 2018. 287 с.
4. Гусак Д. В. Збірник задач з теорії випадкових процесів та її застосувань у фінансовій математиці та теорії ризику. Київський національний ун-т ім. Тараса Шевченка. К.: ВПЦ «Київський ун-т», 2018. 287 с.
5. Закон України «Про внесення змін до деяких законодавчих актів України щодо спрощення залучення інвестицій та запровадження нових фінансових інструментів» від 19.06.2020 р.
6. Закон України «Про валюту і валютні операції» №2473-VIII від 21.06.2018 р.
7. Клапків М. С. Страхування фінансових ризиків: монографія. Тернопіль: Економічна думка, Карт-бланш, 2012. 570 с.
8. Красавіна Л.Н. Проблеми запобігання кризи на фінансовому ринку. К.: Фінанси і кредит, 2018. 184 с.
9. Лактіонова О. А. Буферизація фінансової стабільності на основі формування механізму макропруденційного регулювання. *Економіка, організація, управління.* 2016. С. 127–142.
10. 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
11. Методичні рекомендації з управління ризиками в платіжних системах, 2020. URL: https://bank.gov.ua/ua/news/all/metodichni-rekomendatsiyi-z-upravlin- nya-

rizikami-v-platijnih-sistemah

Інформаційні ресурси

1. Сайт Світового валютного фонду. URL: http://www.imf.org;
2. Базельський комітет із банківського нагляду (Basel Committee on Bancing Supervision). URL: http://www.bis.org;
3. Сайт Державної комісії з цінних паперів та фондового ринку. URL: http://www.ssmsc.gov.ua;
4. Сайт Світової федерації фондових бірж. URL: http://www.ssmsc.gov.ua;
5. Сайт Національного банку України. URL: www.bank.gov.ua;
6. Сайт Першої фонової торгівельної системи. URL:www.pfts.com;
7. Сайт Державного комітету статистики України. URL: www.ukrstat.gov.ua;
8. Сайт Світового банку. URL: www.worldbank.org.
9. *Global Financial Stability Report* (GFSR) ½ year issues. URL: https:// www.imf.org/en/Publications/GFSR/Issues/2018/04/02/Global-Financial-Stability-Re- port-April-2018
10. Essentials of Risk Measurement – FinanceTrain. URL: http://financetrain.com