

**Назва.** Управління банківськими ризиками

**Тип.** Базова.

**Рік навчання.** 2019–2020.

**Семестр.** 2.

**Кількість кредитів ЄКТС.** 4.

**ПІБ лектора, науковий ступінь, посада.** Омельченко О.І., к. е. н., доц.

**Результати навчання.**

здатність визначати оптимальні управлінські рішення в умовах невизначеності;

здатність визначати оптимальні управлінські рішення в умовах конфлікту;

уміння проводити аналіз впливу невизначеності на якість прийняття управлінських рішень;

уміння здійснювати обґрунтований вибір економіко-математичних методів та моделей для формування ефективних управлінських рішень;

уміння прогнозувати управлінські рішення з урахуванням впливу факторів зовнішнього середовища;

здатність формувати механізм управління ризиками банківської діяльності;

здатність визначати інтегральні показники оцінювання ризику банківської діяльності;

уміння формувати напрями підвищення ефективності управлінських рішень у разі здійснення банківських операцій.

**Обов'язкові попередні навчальні дисципліни.** "Банківська система", "Аналіз банківської діяльності", "Операції банків з цінними паперами", "Статистика".

**Зміст.**

Теоретичні засади економічних ризиків. Процес управління банківськими ризиками. Організація та функціонування системи ризик-менеджменту в банку. Виявлення та ідентифікація банківських ризиків. Методи управління банківськими ризиками. Управління інвестиційними ризиками в банку. Хеджування ризиків у банку. Управління фінансовими неціновими ризиками банку. Управління функціональними ризиками банку. Контроль за банківськими ризиками.

**Рекомендовані джерела.**

1. Васильєва Т. А. Управління ризиками банків / Т. А. Васильєва, А. О. Єпіфанов, С. М. Козьменко. – Суми : ДВНЗ "УАБС НБУ", 2012. – 283 с.
2. Криклій О. А. Управління кредитним ризиком банку : монографія / О. А. Криклій, Н. Г. Маслак. – Суми : ДВНЗ "УАБС НБУ", 2008. – 86 с.

3. Матвійчук А. В. Аналіз і управління економічним ризиком : навч. посіб. для студ. вищ. навч. закладів / А. В. Матвійчук ; Вінниц. нац. технік. ун-т. – Київ : Центр навчальної літератури, 2005. – 219 с.
4. Примостка Л. Банківські ризики. Теорія та практика управління : монографія / Л. Примостка, О. Лисенок, О. Чуб. – Київ : КНЕУ, 2008. – 456 с.
5. Савченко Т. Г. Банківська система у формуванні та підтриманні рівноважних станів в економіці : монографія / Т. Г. Савченко. – Суми : ДВНЗ "УАБС НБУ", 2012. – 368 с.
6. Управління банківськими ризиками : навч. посіб. / [за ред. Л. Примостка]. – Київ : КНЕУ, 2009. – 600 с.
7. Управління ризиками та економічною безпекою : навч.-метод. посіб. для самост. вивч. дисципліни / [О. Д. Гудзинський, С. М. Судомир, Т. О. Гуренко, Н. В. Гайдамак]. – Київ : ІПК ДСЗУ, 2010. – 237 с.
8. Галапуп Н. Д. Управління ризиками в банківській діяльності / Н. Д. Галапуп ; Тернопільська академія народного господарства. – Тернопіль : Вид-во "Економічна думка", 2001. – 225 с.
9. Губарева І. О. Забезпечення управління економічною безпекою банку : монографія / І. О. Губарева, О. М. Штаєр. – Харків : ІНЖЕК, 2013. – 309 с.
10. Колодізев О. М. Забезпечення умов стабільного функціонування банківського сектору України : монографія / за заг. редакцією О. М. Колодізева. – Харків : Вид. ХНЕУ, 2010. – 310 с.
11. Колодізев О. М. Фінансовий менеджмент у банках: концептуальні засади, методологія прийняття рішень у банківській сфері : навч. посіб. / О. М. Колодізев, І. М. Чмутова, І. О. Губарева. – Харків : ВД "ІНЖЕК", 2004. – 408 с.
12. Пікус Р. В. Управління фінансовими ризиками : навч. посіб. / Р. В. Пікус. – Київ : Знання, 2010. – 598 с.

#### **Методи навчання.**

Лекції (лекції проблемного характеру, міні-лекції та робота в малих групах) та практичні заняття (семінари-дискусії, кейси, ділові ігри).

#### **Методи оцінювання:**

- поточний контроль (опитування, вирішення компетентнісно-орієнтованих завдань);
- підсумкова контрольна робота
- підсумковий контроль (залік).

**Мова навчання.** Українська.