

Навчальна дисципліна Ризик-менеджмент у банку

1.	Інформація про навчально-науковий інститут	ННІ «Каразінський банківський інститут»
2.	Рівень вищої освіти	Другий (магістерський)
3.	Курс навчання	Перший курс другого (магістерського) рівня вищої освіти
4.	Спеціальність	D2 Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок
5.	Назва ОПП	Фінансові технології та банківський бізнес
6.	Обсяг освітнього компонента в кредитах ЕКТС (та його розподіл у годинах)	6 кредитів ЕКТС (180 год.)
7.	Мінімальна кількість здобувачів	10 осіб
8.	Попередні умови вивчення дисципліни (пререквізити)	Банківська студія «Корпоративне управління», Банківський менеджмент, Фінансово-банківські технології, Фінансовий моніторинг
9.	Семестр (осінній/ весняний)	весняний
10.	Кафедра, що забезпечує викладання	Банківського бізнесу та фінансових технологій
11.	Контактні дані розробників робочої програми навчальної дисципліни	Кандидат економічних наук, доц. Кочорба В.Ю. v.y.kochorba@karazin.ua
12.	Науково-педагогічні працівники, залучені до викладання	Кандидат економічних наук, доц. Кочорба В.Ю. v.y.kochorba@karazin.ua
13.	Мета дисципліни	Підготовка фахівців високого рівня з ризик-менеджменту, які володіють фундаментальними знаннями і практичними навичками з фінансів, банківської справи, страхування та фондового ринку з подальшим вмінням їх застосовувати задля ефективного управління взаємовідносинами на фінансовому ринку, діяльністю фінансових посередників та основними з них - банками.
14.	Очікувані результати навчання	<i>Програмні результати навчання зі спеціальності:</i> ПР1. Використовувати фундаментальні закономірності розвитку фінансів, банківської справи та страхування у поєднанні з дослідницькими і управлінськими інструментами для здійснення професійної та наукової діяльності. ПР6. Доступно і аргументовано представляти результати досліджень усно і письмово, брати участь у фахових дискусіях. ПР7. Вирішувати етичні дилеми з опорою на норми

		закону, етичні принципи та загальнолюдські цінності. ПР8. Вміти застосовувати інноваційні підходи у сфері фінансів, банківської справи та страхування та управляти ними. ПР9. Застосовувати управлінські навички у сфері фінансів, банківської справи та страхування. ПР11. Застосовувати поглиблені знання в сфері фінансового, банківського та страхового менеджменту для прийняття рішень. ПР12. Обґрунтувати вибір варіантів управлінських рішень у сфері фінансів, банківської справи та страхування та оцінювати їх ефективність з урахуванням цілей, наявних обмежень, законодавчих та етичних аспектів. ПР13. Оцінювати ступінь складності завдань при плануванні діяльності та опрацюванні її результатів. <i>Програмні результати навчання, визначені за освітньою програмою:</i> ПР15. Застосовувати поглиблені знання в у сфері оцінки зовнішніх та внутрішніх загроз, ризиків, небезпек та підвищення стійкості фінансових систем.
15.	Теми аудиторних занять	Тема 1. Теоретичні засади економічних ризиків в системі управління ризиками банківської діяльності. Тема 2. Організація та функціонування системи ризик-менеджменту в банку. Тема 3. Ідентифікація та оцінювання банківських ризиків. Тема 4. Управління фінансовими неціновими ризиками банку. Сутність та джерела виникнення кредитних ризиків у діяльності банку. Тема 5. Управління фінансовими ризиками банку. Сутність ризику ліквідності та системний підхід до його оцінювання. Тема 6. Управління фінансовими ризиками банку. Ризики інвестиційного портфеля та їх диверсифікація. Тема 7. Управління фінансовими ризиками банку. Хеджування ризиків у банку. Тема 8. Управління функціональними ризиками банку. Мінімізація операційного ризику банку. Тема 9. Управління функціональними ризиками банку. Ризик репутації та методи мінімізації. Тема 10. Управління функціональними ризиками банку. Стратегічний ризик.

		Тема 11. Управління функціональними ризиками банку. Юридичний ризик та комплаєнс-ризик. Тема 12. Контроль ризиків в банку та оцінка ефективності системи управління ризиками.
16.	Теми самостійної роботи	Тема 1. Теоретичні засади економічних ризиків в системі управління ризиками банківської діяльності. Тема 2. Організація та функціонування системи ризик-менеджменту в банку. Тема 3. Ідентифікація та оцінювання банківських ризиків. Тема 4. Управління фінансовими неціновими ризиками банку. Сутність та джерела виникнення кредитних ризиків у діяльності банку. Тема 5. Управління фінансовими ризиками банку. Сутність ризику ліквідності та системний підхід до його оцінювання. Тема 6. Управління фінансовими ризиками банку. Ризики інвестиційного портфеля та їх диверсифікація. Тема 7. Управління фінансовими ризиками банку. Хеджування ризиків у банку. Тема 8. Управління функціональними ризиками банку. Мінімізація операційного ризику банку. Тема 9. Управління функціональними ризиками банку. Ризик репутації та методи мінімізації. Тема 10. Управління функціональними ризиками банку. Стратегічний ризик. Тема 11. Управління функціональними ризиками банку. Юридичний ризик та комплаєнс-ризик. Тема 12. Контроль ризиків в банку та оцінка ефективності системи управління ризиками.
17.	Методи контролю результатів навчання	Екзамен – весняний семестр; 60 балів – поточний контроль (у т.ч. контрольна робота) та самостійна робота студентів; 40 балів – підсумковий контроль: екзамен в письмовій формі (2 ак. години) Оцінювання відбувається за чотирирівневою шкалою ECTS.