

## Навчальна дисципліна БАНКІВСЬКІ РИЗИКИ

Факультет: економічний

**Статус:** вибіркова

**Курс:** 5

**Семестр:** 9

**Кількість залікових кредитів ECTS** -3

**Попередні умови вивчення:** навчальні дисципліни – гроші та кредит, банківські операції, кредитний менеджмент.

### ОПИС ДИСЦИПЛІНИ

**Мета:** оволодіння та засвоєння знань з питання діяльності банку в умовах невизначеності та ризику, а також розвиток логічного мислення у студентів щодо пошуку найбільш ефективних управлінських рішень в ринковій економіці.

**Завдання:** формування цілісної системи знань, щодо способів та методів оцінки ризиків та їх адекватного відображення в управлінській інформації; оволодіння методологією управління банківськими ризиками; розширення і поглиблення знань з питань регулювання діяльності банків з боку держави та спеціальних органів нагляду за їх ризиковою діяльністю.

**Предмет:** теоретичні та практичні питання аналізу, оцінювання та запобігання банківським ризикам.

### ПРОГРАМА:

- Розділ 1. Теоретичні аспекти ідентифікації та оцінки ризиків.** Теоретичні засади економічних ризиків. Процес управління банківськими ризиками. Організація та функціонування системи ризик-менеджменту в банку. Ідентифікація та оцінювання банківських ризиків.
- Розділ 1. Методи та інструменти управління банківськими ризиками.** Методи управління банківськими ризиками. Управління інвестиційними ризиками в банку. Хеджування ризиків у банку. Управління фінансовими неціновими ризиками банку. Управління функціональними ризиками банку.

## СПИСОК РЕКОМЕНДОВАНОЇ ЛІТЕРАТУРИ

### *Базова література*

1. Управління банківськими ризиками: Навч. посіб. / Л.О.Примостка, П.М. Чуб, Г.Т. Карчева та інші; за заг. ред. д-ра екон. наук, проф. Примостки Л.О. – К.: КНЕУ, 2007. – 600 с.
2. Банковские риски: учебное пособие / кол. авторов; под ред. д-ра экон. наук, проф. О.И. Лаврушина и д-ра экон. наук, проф. Валенцевой. – М.: КНОРУС, 2007. – 232 с.
3. Бланк И.А. Управление финансовыми рисками: Учеб.курс / И.А. Бланк. – К: Ника-Центр, 2006. – 448 с.
4. Варлавен К. Д. Управление рисками коммерческого банка. — Copyright Мировой банк реконструкции и развития, 1993. — 94 с.
5. Внутрішньобанківське регулювання кредитних ризиків / Г.О. Партин, Л.Я. Слобода / Монографія. За наук. ред. д-ра екон. наук Т. С. Смовженко. – К.: УБС НБУ, 2007. – 231 с.
6. Грюнинг Х. Ван, Брайнович-Братанович С. Анализ банковских рисков. Система оценки корпоративного управления и управления финансовым риском / Пер. с англ. – М.: Издательство "Весь Мир", 2004. – 304 с.
7. Інструментарій аналізу в системі кредитного ризик-менеджменту / О.В. Васюренко, В.Ю. Подчесова / Монографія. За наук. ред. д-ра екон. наук. О.В. Васюренко. – К.: УБС НБУ, 2010. – 211 с.

**Форми та методи навчання:** лекції, семінарські заняття, тестування, консультації, індивідуальні завдання, реферати.

**Форми організації контролю знань, система оцінювання:**

*Поточний контроль:* усне опитування та письмовий контроль на семінарських заняттях, лекціях; тестування, письмові контрольні роботи з кожного з двох розділів програми дисципліни.

*Підсумковий контроль: залік (9 семестр);*

*Оцінювання здійснюється за чотирьох бальною шкалою та шкалою ECTS.*

*Критерії оцінювання знань наведені в робочій програмі.*

***Навчально-методичне забезпечення:*** НМКД – програма навчальної дисципліни, матеріали до семінарських занять та самостійної роботи, комплекти завдань для контрольних робіт, письмового заліку.