

МІЖРЕГІОНАЛЬНА АКАДЕМІЯ УПРАВЛІННЯ ПЕРСОНАЛОМ
НАВЧАЛЬНО-НАУКОВИЙ ІНСТИТУТ УПРАВЛІННЯ, ЕКОНОМІКИ ТА
БІЗНЕСУ



Кафедра фінансів, банківської та страхової справи

Затверджую:

Директор ННУЕБ
Семенець-Орлова І.А.

« 30 » серпня 2024 р.



Схвалено на засіданні

кафедри фінансів, банківської та страхової справи

Протокол № 1 від «30» серпня 2024 р.

Завідувач кафедри Кришталь Г.О.

СИЛАБУС
НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ
АНАЛІЗ ФІНАНСОВИХ РИЗИКІВ

Спеціальності: 072 Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок
Освітнього рівня: першого (бакалаврського)
Освітньо-професійної програми: Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок

Київ МАУП 2024

Розробник силябуса навчальної дисципліни:

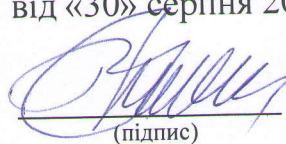
Кришталь Г.О., д.е.н., професор, завідувач кафедри фінансів, банківської та страхової справи, ННІУЕБ.

Викладач:

Кришталь Г.О., д.е.н., професор, завідувач кафедри фінансів, банківської та страхової справи, ННІУЕБ.

Силябус розглянуто та затверджено на засіданні кафедри фінансів, банківської та страхової справи (протокол № 1 від «30» серпня 2024 р.).

Завідувач кафедри



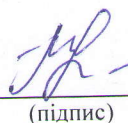
Г.О. Кришталь

(підпис)

Силябус погоджено з гарантом освітньо-наукової програми (керівником освітньо-професійної програми) «Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок».

«30» серпня 2024 р.

Керівник освітньо-професійної програми



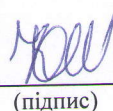
І.О. Брюховецька

(підпис)

Силябус перевірено

«30» серпня 2024 р.

Заступник директора ННІУЕБ



І.І. Каліна

(підпис)

Пролонговано:

на 20__/20__ н.р. _____ (підпис) _____ (ПІБ), «__» _____ 20__ р., протокол № ____

на 20__/20__ н.р. _____ (підпис) _____ (ПІБ), «__» _____ 20__ р., протокол № ____

на 20__/20__ н.р. _____ (підпис) _____ (ПІБ), «__» _____ 20__ р., протокол № ____

на 20__/20__ н.р. _____ (підпис) _____ (ПІБ), «__» _____ 20__ р., протокол № ____

ПрАТ «ВНЗ «Міжрегіональна Академія управління персоналом»
ННІ управління, економіки та бізнесу
Кафедра фінансів, банківської та страхової справи

Назва дисципліни	Аналіз фінансових ризиків
Викладач (-і)	Кришталь Галина Олександрівна
Портфоліо викладача (-ів)	https://maup.com.ua/ua/pro-akademiyu/instituti/institut-ekonomiki/kafedra-bank-strahovoi-spravi.html
Контактний тел.	+38-(097)-87-93-904
E-mail:	gkryshtal@ukr.net
Сторінка дисципліни на сайті	https://maup.com.ua/ua/pro-akademiyu/instituti/institut-ekonomiki/kafedra-bank-strahovoi-spravi/silabusi8.html
Консультації	Очні консультації: згідно розкладу

1. Коротка анотація до дисципліни. Дисципліна «Аналіз фінансових ризиків» спрямована на формування у здобувачів вищої освіти знань і навичок з ідентифікації, оцінки та управління фінансовими ризиками у діяльності підприємств і фінансових установ. Вивчення курсу охоплює основні види фінансових ризиків (кредитний, валютний, ринковий, інвестиційний, процентний, ліквідності та операційний) і методи їх кількісного аналізу. Особлива увага приділяється інструментам хеджування, диверсифікації, страхування ризиків та антикризовим стратегіям. Опанування дисципліни забезпечує здобувачів практичними навичками для прийняття обґрунтованих фінансових рішень і розробки ефективних стратегій ризик-менеджменту.

2. Мета: Метою вивчення дисципліни «Аналіз фінансових ризиків» є формування у здобувачів вищої освіти системних знань, аналітичного мислення та практичних навичок для ідентифікації, оцінки та ефективного управління фінансовими ризиками в умовах динамічного ринкового середовища. Курс спрямований на розвиток здатності приймати обґрунтовані управлінські рішення, спрямовані на мінімізацію фінансових втрат, підвищення стійкості підприємств і фінансових установ, а також забезпечення їх довгострокової конкурентоспроможності.

Завдання:

- Ознайомити здобувачів вищої освіти з теоретичними основами фінансових ризиків, їх класифікацією, джерелами виникнення та впливом на фінансово-економічну діяльність підприємств і фінансових установ.
- Сформувати навички ідентифікації різних видів фінансових ризиків (кредитного, ринкового, валютного, інвестиційного, процентного, ризику ліквідності та операційного) та визначення їх потенційного впливу на фінансову стійкість організацій.

- Навчити використовувати сучасні методи та інструменти кількісного і якісного аналізу фінансових ризиків, включаючи статистичні моделі, сценарне моделювання, аналіз чутливості та стрес-тестування.
- Ознайомити з практичними підходами до управління фінансовими ризиками, включаючи стратегії хеджування, диверсифікації, страхування ризиків та створення резервних фондів.
- Розвинути вміння застосовувати антикризові стратегії та інструменти ризик-менеджменту для забезпечення фінансової стійкості підприємств у нестабільних економічних умовах.
- Сприяти набуттю практичних навичок роботи з програмними засобами для аналізу фінансових ризиків та прийняття управлінських рішень.
- Сформувати здатність оцінювати ефективність впроваджених стратегій управління ризиками та здійснювати коригування фінансових планів відповідно до змін ринкового середовища.

3. Формат курсу: очний (*offline*).

5. Програмні результати навчання (інтегральні, фахові компетентності):

Таблиця 1

Компетентність	Ступінь сформованості компетентності	Оцінювання
Здатність розв'язувати складні спеціалізовані задачі та практичні проблеми у галузі фінансової діяльності підприємств, установ та організацій усіх форм власності та видів економічної діяльності, що передбачає застосування певних теорій та методів фінансів і характеризується комплексністю та невизначеністю фінансового середовища та умов господарювання	Частково. Разом з іншими освітніми компонентами освітньої програми	Поточне, рубіжне (модульний контроль), підсумкове (іспит)
Здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу із використанням законів логіки та їх застосування у практичних ситуаціях.	Частково. Разом з іншими освітніми компонентами освітньої програми	Поточне, рубіжне (модульний контроль), підсумкове (іспит)
Соціальні та етичні зобов'язання: формування навичок соціальної відповідальності професійної діяльності та етичних зобов'язань з точки зору професійної етики.	Частково. Разом з іншими освітніми компонентами освітньої програми	Поточне, рубіжне (модульний контроль), підсумкове (іспит)
Соціально-особистісні навички: адаптивність, комунікабельність, креативність, толерантність, здатність до системного мислення та самовдосконалення, формування стійкого світогляду та наполегливість у досягненні мети.	Частково. Разом з іншими освітніми компонентами освітньої програми	Поточне, рубіжне (модульний контроль), підсумкове (іспит)

6. Тривалість курсу. 90 годин (3 кредити ЄКТС), з них: 34 години аудиторної роботи; 56 годин – самостійної роботи, залік.

7. Статус дисципліни: *вибіркова професійної підготовки.*

8. Пререквізити: Зміст курсу розкриває об'єктивний характер функціонування фінансово-кредитних організацій, що дозволяє сформувати у майбутніх фахівців необхідний категоріальний апарат для подальшого вивчення таких дисциплін як «Міжнародні фінанси», «Банківська система» тощо.

9. Технічне й програмне забезпечення/обладнання: В освітньому процесі використовуються навчальні аудиторії, комп'ютерні лабораторії, конференц-зали, бібліотека. Вивчення окремих тем і виконання практичних завдань потребує доступу до інформації зі всесвітньої мережі Інтернет, який забезпечується безкоштовною мережею Wi-Fi.

10. Політика курсу: Курс «Аналіз фінансових ризиків» передбачає засвоєння та дотримання принципів академічної доброчесності, зокрема орієнтації на запобігання плагіату у будь-яких його проявах: всі роботи, доповіді та презентації мають бути оригінальними та авторськими, не переобтяженими цитатами, що мають супроводжуватися посиланнями на першоджерела. Завдання мають бути виконані вчасно, у встановлені терміни; відпрацювання пропущених занять можливе під час самостійної підготовки та консультацій викладача.

11. Зміст дисципліни: Курс складається з двох змістових модулів. Кожен модуль, у свою чергу, складається з лекційної та семінарської частин (див. навчально-методичну карту дисципліни в додатку):

Перший змістовий модуль «Теоретико-методологічні основи аналізу фінансових ризиків» передбачає опанування здобувачами вищої освіти базових теоретичних знань щодо сутності, класифікації та природи фінансових ризиків, а також методологічних підходів до їх аналізу та оцінки. У рамках модуля розглядаються джерела виникнення ризиків, фактори впливу на фінансову стійкість підприємств, методи ідентифікації та кількісної оцінки ризиків (статистичний аналіз, сценарне моделювання, аналіз чутливості, стрес-тестування), а також правові та нормативні аспекти управління фінансовими ризиками відповідно до національних і міжнародних стандартів.

Другий змістовий модуль «Практичні аспекти управління фінансовими ризиками» спрямований на розвиток практичних навичок здобувачів щодо управління фінансовими ризиками з використанням сучасних інструментів і методів. Вивчення модуля охоплює аналіз основних видів фінансових ризиків (кредитного, валютного, ринкового, інвестиційного, процентного, ліквідності та операційного), опанування інструментів їх мінімізації (хеджування, диверсифікація, страхування, деривативи), розробку антикризових стратегій, застосування програмного забезпечення для моделювання ризиків та оцінку ефективності впроваджених ризик-менеджмент стратегій.

12. Форми і методи навчання.

Основними видами навчальних аудиторних занять є лекції, семінарські заняття, консультації.

При викладанні *лекційного матеріалу* передбачено поєднання таких форм і методів навчання, як проблемні лекції, лекції-візуалізації.

Проблемна лекція забезпечує безпосередній контакт викладача з аудиторією і дозволяє привернути увагу здобувачів до найбільш важливих проблематичних питань з відповідної теми, визначаючи у процесі діалогу особливості сприйняття навчального матеріалу та спонукаючи слухачів до критичного та самостійного мислення, до осмислення всіх наявних аргументів «за» та «проти», до формування та обґрунтування власної позиції.

Лекція-візуалізація включає візуальну форму подачі лекційного матеріалу за допомогою технічних засобів навчання. Читання такої лекції зводиться до розгорнутого або короткого коментування викладачем візуальних матеріалів, що переглядаються.

При проведенні *семінарських занять* передбачено поєднання таких форм і методів навчання, як-от: робота у малих групах, рольові ігри, дискусія, публічні виступи, виступи з опонуванням, групові проекти та кейс-завдання.

Здобувачі опрацьовують інформацію та проводять дослідження самостійно, у свій вільний час, в тому числі за допомогою всесвітньої мережі Інтернеті бібліотек (див. *рекомендовану літературу*), під час занять виконують усні та письмові завдання, виступають із доповідями та презентаціями, що можуть бути підготовленими як у групі, так і індивідуально.

13. Оцінювання знань здійснюється відповідно до «Положення про оцінювання навчальних досягнень здобувачів вищої освіти у ПрАТ «ВНЗ «МАУП» (<https://maup.com.ua/assets/files/publ-adm/nakaz-191.1-0.pdf>).

Система оцінювання навчальних досягнень

Вид діяльності здобувача	Максимальна к-сть балів за одиницю	Модуль 1		Модуль 2	
		кількість одиниць	максимальна кількість балів	кількість одиниць	максимальна кількість балів
Відвідування лекцій	1	12	12	11	11
Відвідування семінарських занять	1	6	6	6	6
Робота на семінарському занятті	10	6	60	6	60
Виконання завдань для самостійної роботи	5	1	5	2	10
Виконання модульної роботи	25	1	25	1	25
Виконання ІНДЗ	30	-	-	1	30
Разом	-		108		142
Максимальна кількість балів:					250
250:100=2,5. Здобувач набрав Х балів; Розрахунок: Х:2,5 = загальна кількість балів.					

14. Завдання для самостійної роботи та критерії її оцінювання.

Під час вивчення курсу виконуються 2 самостійні роботи.

Самостійна робота 1 (змістовий модуль 1).

Методи ідентифікації та класифікації фінансових ризиків: теоретичний аналіз та сучасні підходи.

Самостійна робота 2 (змістовий модуль 2). Застосування інструментів хеджування для мінімізації фінансових ризиків: практичний кейс-аналіз.

Індивідуальні завдання подаються у вигляді аналітичної записки (5-10 стор.) або презентації (8-10 слайдів), що має (на відміну від реферату) не тільки відбивати опрацювання базових посібників і володіння основними категоріями, а й передбачає збір аналітичної інформації, на підставі якої здійснюється доведення чи спростування базового положення. Тема відповідає одній із тем навчального плану, структура роботи узгоджується з викладачем.

Критерії оцінювання:

- відповідність вимогам щодо змісту та стилю оформлення – 3 бали;
- грамотність, змістовність – 2 бали;
- наявність актуальних аналітичних даних – 15 балів;

Максимальний загальний результат самостійної роботи: 5 балів.

Максимальний загальний результат індивідуального завдання: 30 балів.

15. Форми проведення модульного контролю та критерії оцінювання.

Модульний контроль здійснюється у вигляді *тестування*.

Студентами пропонуються тестові завдання у кількості 25 питань.

Види тестових завдань:

- З вибором однієї правильної відповіді з наведених варіантів;
- З вибором кількох правильних відповідей;
- На встановлення відповідності запропонованих наборів тверджень;
- Завдання відкритого типу, що передбачає розгорнуту відповідь.

Критерії оцінювання: виконання тестових завдань – максимум 25 балів.

15. Форми проведення семестрового контролю та критерії оцінювання: Залік.

Іспит проводиться в усній формі: до завдання входять 2 теоретичних питання, за відповідь на які максимально можливо отримати 20 балів, термінологічний словник – 5 термінів – 10 балів.

Перерахування у традиційну систему:

- 30 балів – здобувач надав правильні та повні відповіді на всі запитання: «відмінно», А, 100-90 балів;
- 20 балів – здобувач відповів на всі запитання, проте допустив певні неточності у визначеннях базових категорій, які не впливають на правильність відповіді в цілому: «добре», В/С, 89–75 балів;
- 15 балів – здобувач відповів недостатньо повно і конкретно на поставлені запитання, хоч і відобразив знання основного програмного матеріалу; ця оцінка також відповідає правильній відповіді на одне з двох поставлених питань: «задовільно», D/E, 74–60 балів;

• 0 балів – здобувач надав неправильні відповіді на поставлені запитання, виявив неналежний рівень знань теоретичного та нормативного матеріалу та неспроможність послідовно і правильно аргументувати свою відповідь, або взагалі не в змозі відповісти на поставлені запитання: «не зараховано», F–FX, 59–0.

ЗАГАЛЬНА ПІДСУМКОВА ОЦІНКА (в балах) = результати поточної роботи + результати іспиту.

16. Орієнтовний перелік питань для семестрового комплексного контролю.

1. Поняття фінансових ризиків та їх економічна сутність.
2. Класифікація фінансових ризиків за джерелами виникнення.
3. Основні принципи управління фінансовими ризиками.
4. Джерела виникнення фінансових ризиків у діяльності підприємств.
5. Характеристика внутрішніх та зовнішніх факторів фінансових ризиків.
6. Роль фінансового аналізу в управлінні фінансовими ризиками.
7. Система управління фінансовими ризиками: структура та функції.
8. Основні етапи аналізу фінансових ризиків.
9. Сутність ризик-менеджменту та його завдання.
10. Особливості фінансових ризиків у банківській сфері.
11. Міжнародні стандарти управління фінансовими ризиками (Basel III, ISO 31000).
12. Роль фінансових ризиків у формуванні інвестиційної політики підприємства.
13. Поняття ризику ліквідності та фактори, що на нього впливають.
14. Операційний ризик: визначення, джерела виникнення та методи мінімізації.
15. Вплив макроекономічних факторів на рівень фінансових ризиків.
16. Психологічні аспекти прийняття рішень в умовах фінансового ризику.
17. Види валютних ризиків та їх характеристика.
18. Сутність процентного ризику та його вплив на фінансові результати.
19. Фінансові ризики у страховій діяльності.
20. Специфіка фінансових ризиків на фондовому ринку.
21. Методи якісного аналізу фінансових ризиків.
22. Статистичні методи оцінки фінансових ризиків.
23. Коефіцієнтний аналіз у фінансовому ризик-менеджменті.
24. Застосування сценарного аналізу для прогнозування фінансових ризиків.
25. Сутність і методика аналізу чутливості.
26. Принципи використання стрес-тестування в оцінці фінансових ризиків.
27. Оцінка ймовірності виникнення фінансових ризиків.
28. Експертні методи аналізу фінансових ризиків.
29. Інтерпретація показників фінансової стійкості підприємства.

30. Порівняльний аналіз методів оцінки ризику інвестиційних проєктів.
31. Методика побудови карти фінансових ризиків.
32. Методи аналізу ринкових ризиків.
33. Застосування VaR (Value at Risk) для оцінки фінансових ризиків.
34. Аналіз фінансової звітності як інструмент оцінки ризиків.
35. Визначення кредитного ризику та підходи до його аналізу.
36. Методи оцінки валютного ризику.
37. Оцінка процентного ризику та його вплив на фінансові показники.
38. Методика аналізу ліквідності та платоспроможності підприємства.
39. Інтегровані моделі управління ризиками (ERM – Enterprise Risk Management).
40. Методи оцінки інвестиційного ризику в умовах невизначеності.
41. Поняття хеджування та його роль у мінімізації фінансових ризиків.
42. Інструменти хеджування: форварди, ф'ючерси, опціони, свопи.
43. Порівняння ефективності різних методів хеджування.
44. Використання страхування для зниження фінансових ризиків.
45. Застосування деривативів для управління ринковими ризиками.
46. Диверсифікація активів як інструмент зниження фінансових ризиків.
47. Методи оптимізації фінансового портфеля.
48. Резервні фонди як засіб покриття непередбачених фінансових втрат.
49. Валютне хеджування: методи та практичні аспекти.
50. Застосування кредитного деривативу для управління кредитним ризиком.
51. Використання антикризового фінансового планування.
52. Методи управління ризиком ліквідності.
53. Оцінка ефективності системи управління фінансовими ризиками.
54. Роль корпоративного управління в управлінні фінансовими ризиками.
55. Вибір оптимальної стратегії управління фінансовими ризиками.
56. Методи мінімізації інвестиційних ризиків.
57. Використання стратегії страхування ризиків у банківській сфері.
58. Управління ризиками в умовах фінансової нестабільності.
59. Вплив глобальних економічних криз на рівень фінансових ризиків.
60. Інноваційні інструменти управління фінансовими ризиками.
61. Використання Excel для фінансового моделювання ризиків.
62. Застосування програмного забезпечення R та Python для аналізу фінансових ризиків.
63. Алгоритм побудови моделей фінансових ризиків.
64. Структура звіту про оцінку фінансових ризиків підприємства.
65. Оцінка ймовірності банкрутства підприємства (моделі Альтмана, Лісса).
66. Застосування індикативних методів оцінки фінансової стійкості.
67. Методика побудови матриці ризиків підприємства.
68. Оцінка ризику ліквідності на основі фінансових коефіцієнтів.
69. Практичний аналіз ринкових ризиків на фондовому ринку.

70. Використання SWOT-аналізу для виявлення фінансових ризиків.
71. Аналіз причин фінансових криз на прикладі реальних кейсів.
72. Застосування багатофакторних моделей для оцінки фінансових ризиків.
73. Виявлення зовнішніх загроз для фінансової стабільності компанії.
74. Аналіз ефективності впроваджених стратегій ризик-менеджменту.
75. Визначення критичних точок для управління фінансовими ризиками.
76. Моделювання фінансових ризиків у нестандартних ринкових умовах.
77. Інтерпретація фінансових показників для оцінки кредитоспроможності.
78. Аналіз фінансових ризиків у банківському секторі України.
79. Практичні підходи до зниження валютного ризику.
80. Методи управління ризиком неплатоспроможності підприємства.
81. Оцінка впливу макроекономічних факторів на фінансові ризики.
82. Використання рейтингових агентств для оцінки фінансових ризиків.
83. Застосування методу Монте-Карло для прогнозування ризиків.
84. Інтеграція ризик-менеджменту в загальну фінансову стратегію підприємства.
85. Практика управління фінансовими ризиками в міжнародних корпораціях.
86. Інноваційні підходи до зменшення фінансових втрат.
87. Використання антикризових стратегій у фінансовому управлінні.
88. Оцінка ризиків інвестиційних проєктів на ранніх стадіях реалізації.
89. Особливості управління фінансовими ризиками в умовах воєнного стану.
90. Сучасні тенденції розвитку систем управління фінансовими ризиками.

17. Шкала відповідності оцінок

Сума балів за всі види навчальної діяльності	Оцінка ECTS	Оцінка за національною шкалою	
		для екзамену, курсового проекту (роботи), практики	для заліку
90 – 100	A	відмінно	зараховано
82-89	B	добре	
75-81	C		
68-74	D	задовільно	
60-67	E		
35-59	FX	незадовільно з можливістю повторного складання	не зараховано з можливістю повторного складання
1-34	F	незадовільно з обов’язковим повторним вивченням дисципліни	не зараховано з обов’язковим повторним вивченням дисципліни

18. Рекомендовані джерела (література):

Основна (базова):

1. Внукова Н. М. Економічна оцінка ризику діяльності підприємств: проблеми теорії та практики : монографія / Н. М. Внукова, В. А. Смоляк. – Харків : ВД «ІНЖЕК», 2006. – 184 с.
2. Гуменюк В.Я., Міщук Г.Ю., Олійник О.О. Управління ризиками: Навч. посіб. – Рівне.: НУВГП, 2009.- 156 с.
3. Долінський Л. Б. Аналіз, моделювання та управління фінансовими інвестиціями : навч. посібник / Л. Б. Долінський, Г. І. Великоіваненко, І. І. Стрельченко. – Київ : КНЕУ, 2016. – 495 с.
4. Долінський Л.Б. Фінансовий ризик-менеджмент: Навч.-метод. посіб. - К.: НаУКМА, 2020. - 132 с.
5. Пікус Р. В. Управління фінансовими ризиками: навч. посіб./ [Пікус Р. В.]. - 2-ге вид., випр. - К.: Знання, 2011. - 598 с.
6. Теорія фінансів: навч. посіб./ [Брюховецька І. О., Кришталь Г. О., Цімошинська О. В. та ін.]. - К.: МАУП, 2024. - 394 с.
7. Шклярук С. Г. Управління фінансовими ризиками: навч. посіб. - К.: Персонал, 2019. - 494 с. Пікус Р.В. Управління фінансовими ризиками: Підручник. – К.: Знання 2010. – 560 с.

Допоміжна література

1. Азаренкова Г. М. Аналіз моделювання і управління ризиком (в схемах та прикладах): навч. посіб. - Львів: Новий Світ-2000, 2011. - 240 с.
2. Аранчій В.І., Томілін О.О., Дорогань-Писаренко Л.О. Фінансовий менеджмент: Навч. посіб. - Полтава: ПДАУ, 2021. - 300 с.
3. Артım-Дрогомирецька З. Б., Негрей М. В. Економічний ризик: навч.-метод. посіб. - Л.: Магнолія 2006, 2013. - 320 с.
4. Боровик М.В. Ризик-менеджмент: Консп. лекцій. - Х.: ХНУМГ, 2018. - 65 с.
5. Боровик М.В. Ризик-менеджмент: Консп. лекцій. - Х.: ХНУМГ, 2023. - 63 с.
6. Верланов Ю.Ю. Фінансовий менеджмент: Навч. посіб. - 2-е вид. - Миколаїв: ЧНУ, 2021. - 336 с.
7. Верхуша Н. П. Механізм управління кредитним ризиком банку: питання теорії та практики: монографія. - Суми: Університетська книга, 2016. - 91 с.
8. Вітлінський В. В. Ризикологія в економіці та підприємстві : монографія / В. В. Вітлінський, Г. І. Великоіваненко. – Київ : КНЕУ, 2004. – 480 с.
9. Гайбура Ю.А. Фінансовий аналіз: Навч. посіб. - Кам'янець-Подільський: ПДАТУ, 2021. - 176 с.
10. Гевлич Л.Л., Гевлич І.Г. Міжнародні стандарти фінансової звітності та аудиту: Навч. посіб. - Вінниця: ДонНУ, 2021. - 128 с.
11. Глущенко О.О., Семеген І.Б. Антилегалізаційний фінансовий моніторинг: ризик-орієнтований підхід: Монографія/ За заг. ред. Р.А. Слав'юка. - К.: УБС НБУ, 2014. - 386 с.

12. Гордієнко Н.І. Аудит фінансової звітності суб'єктів господарювання: Консп. лекцій. - Х.: ХНУМГ, 2023. - 124 с.
13. Демченко Г.В. Ризик-менеджмент: Консп. лекцій. - Х.: ХНЕУ, 2021. - 74 с.
14. Долінський Л.Б. Фінансовий ризик-менеджмент: Навч.-метод. посіб. - К.: НаУКМА, 2020. - 132 с.
15. Дропа Я.Б. Фінансовий аналіз: Навч. посіб. - Львів: ЛНУ, 2023. - 238 с.
16. Економічні ризики: методи вимірювання та управління: навч. посіб./ [За заг. ред Скопенко Н. С.]. - К.: Кондор, 2023. - 348 с.
17. Економічні ризики: методи вимірювання та управління: Навч. посіб./ За заг. ред. Скопенко Н.С. - К.: НУХТ, 2021. - 344 с.
18. Єпіфанова І.Ю., Джеджула В.В. Фінансовий аналіз та звітність: Практикум. - 2-е вид., доп. - Вінниця: ВНТУ, 2022. - 144 с.
19. Коваленко В. В. Фінансові ризики та шляхи їх мінімізації (правовий аспект)/ [Коваленко В. В.]. - К.: Знання, 2011. - 319 с.
20. Когут Ю. І. Технології блокчейн та криптовалюта: ризики та кібербезпека: практич. посіб. - К.: Дакор, 2023. - 316 с.
21. Кондратенко Н.О., Великих К.О. Фінансовий аналіз: Конспект лекцій. - Х.: ХНУМГ, 2020. - 166 с.
22. Лісовська Ю. П. Кібербезпека: ризики та заходи: навч. посіб. - К.: Кондор, 2019. - 272 с.
23. Магопець О.А., Шалімова Н.С., Черновол О.М. Фінансовий аналіз: Навч. посіб. - 2-е вид., випр. і доп. - Кропивницький: ЦНТУ, 2022. - 230 с.
24. Моделі та методи оцінювання економічних ризиків у різних функціональних сферах бізнесу: монографія/ [Вдовин М. Л., Данилюк Л. Г., Лелик Л. І. та ін.]. - Л.: ННБК "АТБ", 2015. - 248 с.
25. Мороз В. М., Мороз С. А. Ризик-менеджмент: навч. посіб. - К.: Кондор, 2019. - 140 с.
26. Мороз В.М., Мороз С.А. Ризик-менеджмент: Навч. посіб. - Х.: ХПІ, 2018. - 140 с.
27. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання ризиків: навч. посіб./ [Ред. Донець Л. І.]. - К.: ЦУЛ, 2012. - 472 с.
28. Олійник О.В., Морозова Г.С. Фінансовий менеджмент: Навч. посіб. - Х.: ХНАУ, 2020. - 154 с.
29. Останкова Л. А., Шевченко Н. Ю. Аналіз, моделювання та управління економічними ризиками: навч. посіб. - К.: ЦУЛ, 2011. - 256 с.
30. Пістунов І. М., Борщ Т. В. Інформаційні системи в фінансово-кредитних установах: навч. посіб. - К.: ЦУЛ, 2024. - 234 с.
31. Приймак С.В. Фінансовий аналіз. Практикум: Навч. посіб. - Львів: ЛНУ, 2021. - 264 с.
32. Система ризик-менеджменту в банках: теоретичні та методологічні аспекти: Монографія/ За ред. Коваленко В.В. - Одеса: ОНЕУ, 2017. - 304 с.
33. Скоропад І. С., Чубка О. М. Фінансова діяльність суб'єктів підприємництва: практикум. - К.: Кондор, 2023. - 140 с.

34. Сорока П. М., Сорока Б. П. Аналіз, моделювання та управління ризиками: навч. посіб. - К.: Університет "Україна", 2011. - 270 с.

35. Стрельбицька Н.Є. Управління ризиками в зовнішньоекономічній діяльності: Консп. лекцій. - Тернопіль: ТНЕУ, 2010. - 81 с.

36. Сулим М. В., Пенцак О. С. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання ризиків: підручник. - Л.: Новий Світ-2000, 2011. - 330 с.

37. Фінанси підприємств: підруч./ [Курило О. Б., Бондаренко Л. П., Вівчар О. Й. та ін.]. - К.: Кондор, 2020. - 340 с.

38. Фінансове планування: навч. посіб./ [Череп А. В., Бугай В. З., Горбунова А. В. та ін.]. - К.: Кондор, 2023. - 292 с.

39. Фінансове планування: практикум/ [Череп А. В., Бугай В. З., Горбунова А. В. та ін.]. - К.: Кондор, 2023. - 196 с.

40. Хома І. Б., Бондаренко Л. П., Чубка О. М. Моделювання фінансових рішень в умовах невизначеності= Modeling financial decisions in conditions of uncertainty: навч. посіб. - К.: Кондор, 2023. - 284 с.

41. Цибульська Е. І. Фінансовий менеджмент: навч. посіб. - К.: Кондор, 2021. - 348 с.

42. Череп А.В., Гамова О. В., Козачок І. А. Фінансовий аналіз: навч. посіб. - К.: Кондор, 2020. - 268 с.

43. Чорноморченко Н. В., Іванова І. С., Приймак Н. С. Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків: навч.-метод. посіб. - Л.: Магнолія 2006, 2015. - 257 с.

44. Чорноморченко Н. В., Іванова І. С., Приймак Н. С. Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків: навч.-метод. посіб. - Л.: Магнолія 2006, 2015. - 257 с.

45. Чубка О. М., Скоропад І. С., Курило О. Б. Фінансова статистика: підруч. - К.: Кондор, 2023. - 212 с.

46. Чубка О. М., Хома І. Б., Ливдар М. В. Фінансовий аналіз: практикум. - К.: Кондор, 2023. - 160 с.

47. Шевченко Н.В., Мельник С.І. Фінансовий менеджмент: Навч. посіб. у схемах і табл. - Львів: ЛьвДУВС, 2022. - 224 с.

Офіційні сайти органів управління фінансами:

1. <http://www.minfin.gov.ua> – сайт Міністерства фінансів України.
2. <http://www.rada.gov.ua> – сайт Верховної Ради України.
3. <http://www.sfs.gov.ua> – сайт Державної фіскальної служби України.
4. <http://www.kmu.gov.ua> – сайт Кабінету Міністрів України.
5. <http://www.treasury.gov.ua> – сайт Державної казначейської служби України.
6. <http://www.pfu.gov.ua> – сайт Пенсійного фонду України.
7. <http://nfp.gov.ua> – сайт Національної комісії, що здійснює регулювання у сфері ринків фінансових послуг.
8. <http://www.nssmc.gov.ua> – сайт Національної комісії з цінних паперів та фондового ринку.

НАВЧАЛЬНО-МЕТОДИЧНА КАРТА ДИСЦИПЛІНИ «АНАЛІЗ ФІНАНСОВИХ РИЗИКІВ»

Разом: 90 год., з них лекції – 20 год., семінарські заняття – 14 год., самостійна робота – 56 год.

№	Кількість балів за семестр 250	Кількість балів		
	Теми лекцій та семінарських занять	Лекції	Семінарські та практичні заняття	Самостійна робота
Змістовий модуль I. Теоретико-методологічні основи аналізу фінансових ризиків				
1.	Сутність та класифікація фінансових ризиків	1 (1 бал) 2 (1 бал)	1 (1+10 балів)	
2.	Методи ідентифікації та оцінки фінансових ризиків	3 (1 бал) 4 (1 бал) 5 (1 бал) 6 (1бал)	2 (1+10 балів)	
3.	Правове та нормативне регулювання управління фінансовими ризиками	7 (1 бал) 8 (1 бал) 9 (1 бал)	3 (1+10 балів) 4 (1+10 балів)	
4.	Методологічні підходи до аналізу фінансових ризиків	10 (1 бал) 11 (1 бал) 12 (1 бал)	5 (1+10 балів) 6 (1+10 балів)	1 (5 балів)
	Поточний контроль	модульна контрольна робота №1 (25 балів)		
Змістовий модуль II. Практичні аспекти управління фінансовими ризиками				
5.	Аналіз основних видів фінансових ризиків	13 (1 бал) 14 (1 бал) 15 (1 бал) 16 (1 бал)	7 (1+10 балів) 8 (1+10 балів)	2 (5 балів)
6.	Інструменти управління фінансовими ризиками	17 (1 бал) 18 (1 бал) 19 (1 бал) 20 (1 бал)	9 (1+10 балів)	
7.	Системи ризик-менеджменту в корпоративному секторі	21 (1 бал) 22 (1 бал)	10 (1+10 балів) 11 (1+10 балів)	3 (5 балів)
8.	Практичні інструменти та кейси аналізу фінансових ризиків	23 (1 бал)	12 (1+10 балів)	4 (5 балів)
	Виконання ІНДЗ	1 (30 балів)		
	Поточний контроль	модульна контрольна робота №2 (25 балів)		
	Підсумковий контроль	Розрахунковий коефіцієнт: 2,5		