

ДЕРЖАВНИЙ НАУКОВО-ДОСЛІДНИЙ ІНСТИТУТ ІНФОРМАТИЗАЦІЇ
ТА МОДЕЛЮВАННЯ ЕКОНОМІКИ

Відділ фінансової політики



«Затверджую»

В.о. директора ДНДІМЕ

Неботов П.Г.

08 2024 р.

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ
ІНВЕСТИЦІЙНА БАНКІВСЬКА ДІЯЛЬНІСТЬ

галузь знань 07 «Управління та адміністрування»
спеціальність 072 «Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок»
освітньо-науковий рівень доктор філософії
вид дисципліни вибіркова

Форма навчання денна
Навчальний рік 2024/2025
Семестр 3
Кількість кредитів ECTS 3
Мова викладання, навчання та оцінювання українська
Форма заключного контролю залік

Пролонговано: на 20__/20__ н.р. _____ («__») _____ 20__ р.
(підпис, ПІБ, дата)

на 20__/20__ н.р. _____ («__») _____ 20__ р.
(підпис, ПІБ, дата)

на 20__/20__ н.р. _____ («__») _____ 20__ р.
(підпис, ПІБ, дата)

Київ – 2024

Робоча програма навчальної дисципліни «Інвестиційна банківська діяльність» розроблена на основі освітньо-наукової програми 072 – Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок» та навчального плану. Підготовлено к.е.н., доц. Черкашиною К.Ф.

ЗАТВЕРДЖЕНО

Начальник відділу фінансової політики
Кульцінський С.В.

(підпис)

(ПІБ)

Протокол № d від «df» 08 2024 р.

МЕТА, ЗАВДАННЯ ТА ПРЕДМЕТ ДИСЦИПЛІНИ

Метою вивчення дисципліни «Інвестиційна банківська діяльність» є формування у студентів системи глибоких професійно-орієнтованих знань щодо механізму фінансового управління інвестиційною банківською діяльністю, а також системи показників оцінки ефективності та результативності його здійснення.

Завданнями дисципліни «Інвестиційна банківська діяльність» є вивчення методів мобілізації та розподілу капіталу, формування оптимальної структури активів з урахуванням ризику і прибутковості, регулювання грошових потоків, фінансового планування і управління фінансовою стійкістю фінансових установ.

Предметом дисципліни є сукупність фінансових відносин у сфері управління активами, пасивами, фінансовими результатами та рухом грошових коштів фінансових установ.

ПЕРЕДУМОВИ ВИВЧЕННЯ ДИСЦИПЛІНИ ЯК ОBOB'ЯЗKОВОЇ КОМПОНЕНТИ ОСВІТНЬОЇ ПРОГРАМИ

Знання:

- одержані під час вивчення таких дисциплін, як «Гроші та кредит» «Аналіз діяльності фінансових посередників», «Фінансовий облік у банках», «Банківські операції», та інших.

Вміння:

- аналізувати зовнішні та внутрішні фактори впливу на діяльність фінансових установ;
- досліджувати тенденції розвитку ринку, на якому функціонує фінансова установа.

РЕЗУЛЬТАТИ ВИВЧЕННЯ ДИСЦИПЛІНИ

Дисципліна «Інвестиційна банківська діяльність», як компонента освітньої програми, забезпечує опанування студентами загальними та фаховими компетентностями і досягнення ними програмних результатів навчання за відповідними освітньо-професійними програмами

Форми навчання – денна та заочна: включають лекційні заняття, семінарські заняття, самостійну та індивідуально-консультаційну роботу, розгляд та аналіз ситуаційних завдань, кейсів, застосування інформаційних технологій та елементи дистанційного.

Організація поточного контролю та підсумкового контролю знань: контрольні заходи включають поточний та підсумковий контроль знань з метою оцінки рівня засвоєння програмних результатів навчання здобувачами вищої освіти за цією програмою. Поточний контроль проводиться у вигляді усного та письмового опитування на семінарських заняттях, підготовки індивідуальних завдань, написання поточних контрольних робіт, які містять:

ОПИС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ Інвестиційна банківська діяльність

Найменування показників	Рівень вищої освіти галузь знань спеціальність
Кількість кредитів - 3	Рівень вищої освіти: третій
Загальна кількість годин – 90 16 лекцій 16 семінарів	Галузь знань 07 «Управління та адміністрування»
	Спеціальність 072 «Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок» Форма семестрового контролю: <i>іспит</i>

СТРУКТУРА ДИСЦИПЛІНИ ТА РОЗПОДІЛ ГОДИН ЗА ТЕМАМИ (ТЕМАТИЧНИЙ ПЛАН)

Назва теми	Кількість годин, у т.ч.				Форми контролю*
	Усього годин/кредитів	Лекції	Практичні заняття	Самостійна робота студентів	
Тема 1. Теоретичні засади інвестиційної діяльності фінансових установ	10	2	2	6	ІРС
Тема 2. Управління власним капіталом фінансових установ	10	2	2	6	РЗ, К
Тема 3. Управління зобов'язаннями фінансових установ	10	1	2	7	РЗ
Тема 4. Управління активами фінансових установ	10	2	2	6	РЗ, ІРС, К
Тема 5. Управління грошовими потоками фінансових установ	10	1	2	7	РЗ, ІРС
Тема 6. Управління ризиками та прибутковістю фінансових установ	10	2	2	6	РЗ, К
Тема 7. Управління ліквідністю фінансових установ	10	2	1	7	РЗ, К
Тема 8. Управління фінансовою стійкістю та надійністю фінансових установ	10	2	2	6	РЗ, К
Тема 9. Антикризове управління фінансовими установами	10	2	1	7	ІРС
Разом	90	16	16	58	
Підсумковий (модульний) контроль – екзамен					

ІРС – індивідуальна робота студентів; ПТ – письмове тестування; К-кейси; РЗ – розв'язок задач.

2. ТЕМАТИКА ТА ЗМІСТ ЛЕКЦІЙНИХ ТА ПРАКТИЧНИХ ЗАНЯТЬ, САМОСТІЙНОЇ РОБОТИ СТУДЕНТІВ

Результати навчання	Навчальна діяльність ¹
<p>Знати: сутність інвестиційної діяльності, принципи, суб'єкти, предмет та зміст етапів фінансового менеджменту.</p> <p>Вміти: критично осмислювати наявні точки зору і обґрунтовувати власну позицію з дискусійних питань; застосовувати теоретичні знання для прийняття управлінських рішень за певних практичних ситуацій.</p>	<p>Тема 1. Теоретичні засади інвестиційної діяльності фінансових установ.</p> <p>1. Формування і розвиток інвестиційної діяльності фінансових установ.</p> <p>2. Сутність, цілі, функції та завдання інвестиційної діяльності фінансових установ.</p> <p>3. Предмет та об'єкти інвестиційної діяльності.</p> <p>☞ Список рекомендованих джерел:</p> <p><i>Нормативний: 1-2, 4-12,</i> <i>Основний: 16-20</i> <i>Додатковий: 21-23</i> <i>Інтернет-ресурси: 47,49</i></p> <p>Самостійна робота студента Опрацювавши джерела [16, 18, 21] дати відповідь на питання для самостійної роботи:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Дискусійні питання щодо тлумачення «інвестиційна діяльність». • Дискусійні питання щодо принципів інвестиційної діяльності. • Дискусійні питання щодо видів інвестиційної діяльності. <p><i>Питання до практичного заняття</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Цілі, функції та завдання інвестиційної діяльності у банках. 2. Цілі, функції та завдання інвестиційної діяльності у страхових компаніях. 3. Цілі, функції та завдання інвестиційної діяльності у недержавних пенсійних фондах. 4. Цілі, функції та завдання інвестиційної діяльності у кредитних спілках. 5. Цілі, функції та завдання інвестиційної діяльності у ломбардах.
<p>Знати: сутність, склад, особливості формування</p>	<p>ТЕМА 2. Управління власним капіталом фінансових установ</p>

¹ Із виділенням курсивом питань, які розглядаються із застосуванням інтерактивних методів навчання

та розподілу капіталу різних фінансових установ;
 мету, завдання, методи та послідовність управління капіталом;
 фактори, що впливають на обсяг капіталу;
 нормативно-правові вимоги щодо обсягів капіталу фінансових установ
Вміти: аналізувати достатність капіталу; розраховувати нормативи капіталу та аналізувати їх дотримання; обчислювати регулятивний капітал банку.

План лекції 1
 1. Сутність, класифікація, та функції фінансового капіталу у різних фінансових установах.
 2. Мета, завдання та послідовність управління фінансовим капіталом.
 4. Нормативно-правові вимоги щодо обсягів власного капіталу фінансових установах.

План лекції 2
 1. Види та методи оцінювання вартості капіталу.
 2. Розрахунок середньозваженої вартості капіталу
 3. Фактори, що впливають на структуру капіталу
 4. Поняття та критерії оптимізації структури капіталу.
 5. Моделі оптимізації структури капіталу

☞ Список рекомендованих джерел:
Нормативний: 4, 6-8, 11-12, 15
Основний: 16-20
Додатковий: 22, 29, 32, 35-36, 41
Інтернет-ресурси: 44-49, 53

Самостійна робота студента

1. Вивчення матеріалу лекції, підготовка до практичного заняття
2. Опрацювавши джерела [16 С.24-58, 18 С. 63-101, 29, 32, 49] дати відповіді на наступні питання:
 1. міжнародні стандарти вимог до капіталу;
 2. інформаційне забезпечення управління капіталом у банках;
 3. інформаційне забезпечення управління капіталом у лізингових компаніях;
 4. інформаційне забезпечення управління капіталом у недержавних пенсійних фондах;
 5. інформаційне забезпечення управління капіталом у кредитних спілках;
 6. інформаційне забезпечення управління капіталом у страхових компаніях, компаніях.

Теми презентацій для студентів спеціалізації "Фінансове посередництво" (підготовка колективних міні-проектів):
 1. Вимоги до капіталу фінансових установ у

	<p>різних країнах світу. Студент самостійно обирає тип фінансової установи.</p>
	<p><i>Питання до практичного заняття 1</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Джерела формування капіталу. 2. Фактори впливу на обсяг капіталу 3. Вимоги Національного банку України щодо обсягів та структури капіталу банку. 4. Нормативно-правові вимоги щодо обсягів капіталу страховиків, лізингових компаній та кредитних спілок. <p><i>Питання до практичного заняття 2</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Підходи до оцінки вартості капіталу 2. Розрахунок середньозваженої вартості капіталу. 3. Фінансовий леверидж та ефект фінансового левериджу. 4. Моделі оптимізації структури капіталу 5. Презентація групових проєктів
<p><i>Знати:</i> особливості управління залученими коштами; особливості управління запозиченими коштами.</p> <p><i>Вміти:</i> аналізувати динаміку та структуру зобов'язань, обґрунтовувати зміни, що відбулися, прогнозувати показники на майбутнє.</p>	<p>ТЕМА 3. Управління зобов'язаннями фінансових установ</p> <p><i>План лекції 1</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Сутність та види зобов'язань фінансових установ. 2. Склад та структура залучених коштів. 3. Цінові та нецінові методи управління залученими коштами. <p><i>План лекції 2</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Склад та призначення запозичених коштів. 2. Основні джерела та умови запозичення коштів у різних типах фінансових установ. <p>▣ Список рекомендованих джерел: <i>Нормативний:</i> 4, 6-8, 11-12, 15 <i>Основний:</i> 16-20 <i>Додатковий:</i> 21-23, 29-32, 35-36, 41-42 <i>Інтернет-ресурси:</i> 44-49, 53</p> <p>Самостійна робота студента</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Вивчення матеріалу лекції, підготовка до практичного заняття 2. Опрацювавши джерела [16 С.24-58, 18 С. 63-101, 23, 30, 49] дати відповіді на наступні питання: <ol style="list-style-type: none"> 1. інформаційне забезпечення управління

	<p>зобов'язаннями у банках;</p> <ol style="list-style-type: none"> 2. інформаційне забезпечення управління зобов'язаннями у лізингових компаніях; 3. інформаційне забезпечення управління зобов'язаннями у недержавних пенсійних фондах; 4. інформаційне забезпечення управління зобов'язаннями у кредитних спілках; 5. інформаційне забезпечення управління зобов'язаннями у страхових компаніях, компаніях. <p><i>Питання до практичного заняття 1</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Основні види зобов'язань банку. 2. Основні види зобов'язань страхових компаній. 3. Основні види зобов'язань недержавних пенсійних фондів. 4. Основні види зобов'язань лізингових компаній. <p><i>Питання до практичного заняття 2</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Порівняльна характеристика залучених та позичених коштів. 2. Оцінка ефективності використання залучених та позичених коштів.
<p><i>Знати:</i> мету і завдання управління активами фінансових установ; інструментарій управління активами; сутність та методи управління кредитним, лізинговим та інвестиційним портфелями.</p> <p><i>Вміти:</i> визначати форми фінансової статистичної звітності, необхідні для управління активами; аналізувати динаміку та структуру активів, обґрунтовувати зміни, що відбулися,</p>	<p>ТЕМА 4. Управління активами фінансових установ</p> <p><i>План лекції 1</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Сутність, їх склад та класифікація активів фінансових установ 2. Сутність та завдання управління активами 3. Принципи та етапи управління активами. 4. Сутність «портфеля активів» та підходи до його класифікації. 5. Завдання та особливості управління портфелями активів у фінансових установах <p><i>План лекції 2</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Поняття та методи управління кредитним портфелем 2. Регулювання концентрації кредитного портфеля

прогнозувати показники на майбутнє; визначати дохідність кредитного лізингового інвестиційного портфеля.

3. Оцінка ефективності управління кредитним портфелем

4. Принципи формування лізингового портфеля

5. Підходи, методи та критерії оптимізації структури лізингового портфеля

6. Фактори, які впливають на дохідність лізингового портфеля

План лекції 3

1. Сутність, види і завдання управління інвестиціями.
2. Стратегії формування портфеля цінних паперів
3. Формування резервів по операціям з цінними паперами
4. Методи оцінки прибутковості портфеля цінних паперів
5. Оцінка ефективності управління портфелем цінних паперів

☞ Список рекомендованих джерел:

Нормативний: 1-4, 6-12, 15

Основний: 16-20

Додатковий: 23-27, 30-32, 35-38

Інтернет-ресурси: 43-48, 50-52

Самостійна робота студента

1. Вивчення матеріалу лекції, підготовка до практичного заняття

Питання, які виносяться на самостійне вивчення:

1. інформаційне забезпечення управління активами у банках;
2. інформаційне забезпечення управління активами у лізингових компаніях;
3. інформаційне забезпечення управління активами у недержавних пенсійних фондах;
4. інформаційне забезпечення управління активами у кредитних спілках;
5. інформаційне забезпечення управління активами у страхових компаніях, компаніях.

☞ Список рекомендованих джерел:

Нормативні джерела: 4-12,

Основний: 16 С.24-58, 18 С. 63-101

	<p><i>Додатковий: 23,30</i> <i>Інтернет-ресурси: 43,47</i></p> <p><i>Питання до практичного заняття 1.</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Поняття та завдання управління оборотними активами. 2. Поняття та завдання управління необоротними активами. 3. Поняття та завдання управління основними засобами 4. Сутність, завдання та особливості управління поточною та довгостроковою дебіторською заборгованістю. 5. Визначення оптимальної структури дебіторської заборгованості, забезпечення ефективного контролю за її рухом та своєчасним поверненням. <p><i>Питання до практичного заняття 2.</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Обчислення дохідності кредитного портфеля банку. 2. Методи оптимізації кредитного портфеля. <p><i>Питання до практичного заняття 3</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Ціноутворення та структуризація лізингових операцій. 2. Ефективність управління лізинговим портфелем
<p><i>Знати:</i> сутність, види та особливості грошових потоків різних фінансових установ; методи та моделі управління грошовими потоками; напрями оптимізації грошових потоків</p> <p><i>Вміти:</i> аналізувати грошові потоки; розраховувати показник «Cash flow»; використовувати методи</p>	<p>ТЕМА 5. Управління грошовими потоками фінансових установ <i>План лекції 1</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Сутність, класифікація та особливості формування грошових потоків. 2. Мета завдання та послідовність етапів управління грошовими потоками. 3. Вхідні грошові потоки та їх характеристика. 4. Вихідні грошові потоки та їх характеристика. <p><i>План лекції 2</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Методи розрахунку показників грошового потоку.

оптимізації грошових потоків.

2. Підходи до оцінки інтенсивності, насиченості, ритмічності грошових потоків.
3. Поняття, критерії та методи оптимізації грошових потоків.
4. Інструменти синхронізації та збалансування грошових потоків.
5. Планування грошових потоків.

▣ Список рекомендованих джерел:

Нормативні джерела: 1-2, 4-12,

Основний: 16-10

Додатковий: 21-23, 28-29, 33

Інтернет-ресурси: 43-53

Самостійна робота студента

1. Вивчення матеріалу лекції, підготовка до практичного заняття

Питання, які виносяться на самостійне вивчення:

1. інформаційне забезпечення управління грошовими потоками у банках;
2. інформаційне забезпечення управління грошовими потоками у лізингових компаніях;
3. інформаційне забезпечення управління грошовими потоками у недержавних пенсійних фондах;
4. інформаційне забезпечення управління грошовими потоками у кредитних спілках;
5. інформаційне забезпечення управління грошовими потоками у страхових компаніях, компаніях.

▣ Список рекомендованих джерел:

Нормативні джерела: 4-12,

Основний: 16 С.24-58, 18 С. 118-153

Додатковий: 23,30

Інтернет-ресурси: 43,47

Питання до практичного заняття 1.

1. Управління грошовими потоками, пов'язаними з операційною, інвестиційною та фінансовою діяльністю.
2. Зміст і завдання управління вхідними грошовими

	<p>потоками.</p> <p>3. Зміст і завдання управління вихідними грошовими потоками.</p> <p>4. Управління грошовими потоками в системі координат «час-ризика-ліквідність»</p> <p><i>Питання до практичного заняття 2.</i></p> <p>1. Розрахунок показника «Net Cash flow».</p> <p>2. Напрями оптимізації грошових потоків.</p> <p>3. Планування грошових потоків.</p> <p>4. Вирішення задач</p>
<p><i>Знати:</i> особливості ризиків фінансових установ; сутність та роль фінансової безпеки фінансових установ; механізм забезпечення фінансової безпеки фінансових установ.</p> <p><i>Вміти:</i> обчислювати показники ризику, та прибутковості; аналізувати їх в динаміці; робити висновки щодо виявлених тенденцій, прогнозувати їх значення на майбутнє; оцінювати фінансову безпеку фінансових установ; обґрунтовувати та приймати управлінські рішення в системі координат «ризик – ризиків прибутковість»; визначати ефективність управління ризиками та прибутком.</p>	<p>ТЕМА 6. Управління ризиками та прибутковістю фінансових установ</p> <p><i>План лекції 1</i></p> <p>1. Сутність, завдання та основні засади управління ризиками.</p> <p>2. Фінансова безпека фінансових установ, її місце та роль у системі управління.</p> <p>3. Методика оцінювання та забезпечення фінансової безпеки фінансових установ.</p> <p><i>План лекції 2</i></p> <p>1. Імунізація балансу фінансових установ.</p> <p>2. Цілі та завдання управління прибутковістю.</p> <p>3. Управління формуванням та розподілом прибутку.</p> <p><i>План лекції 3</i></p> <p>1. Взаємозв'язок між ризиками та прибутковістю фінансових установ.</p> <p>2. Стратегії максимізації прибутку та мінімізації ризиків</p> <p>3. Прийняття управлінських рішень в системі координат «ризик-прибутковість».</p> <p>☞ Список рекомендованих джерел: <i>Нормативні джерела: 1-2, 4-12,</i> <i>Основний: 16-10</i> <i>Додатковий: 21-23, 28-29, 33</i> <i>Інтернет-ресурси: 43-53</i></p>
	<p>Самостійна робота студента</p>

	<p>1. Вивчення матеріалу лекції, підготовка до практичного заняття</p> <p>Питання, які виносяться на самостійне вивчення:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. інформаційне забезпечення управління ризиками та прибутковістю у банках; 2. інформаційне забезпечення управління ризиками та прибутковістю у лізингових компаніях; 3. інформаційне забезпечення управління ризиками та прибутковістю у недержавних пенсійних фондах; 4. інформаційне забезпечення управління ризиками та прибутковістю у кредитних спілках; 5. інформаційне забезпечення управління ризиками та прибутковістю у страхових компаніях, компаніях. <p>□ Список рекомендованих джерел: <i>Нормативні джерела: 4-12,</i> <i>Основний: 16 С.24-58, 18 С. 118-153</i> <i>Додатковий: 23,30</i> <i>Інтернет-ресурси: 43,47</i></p> <hr/> <p><i>Питання до практичного заняття 1.</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Організаційне та інформаційне забезпечення управління ризиками. 2. Етапи управління фінансовими ризиками. <p><i>Питання до практичного заняття 2.</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Кількісні, якісні та комбіновані методи оцінки рівня ризику. 2. Загрози фінансової безпеки фінансово-кредитних установ та шляхи їх подолання <p><i>Питання до практичного заняття 3.</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Фактори, що впливають на прибуток та прибутковість фінансових установ. 2. Особливості отримання прибутку у різних типах фінансових установ.
<p>Знати: проблеми</p>	<p>сутність ТЕМА 7. Управління ліквідністю фінансових установ ліквідності,</p>

<p>зовнішні і внутрішні чинники впливу на ліквідність; мету, завдання і інструментарій управління ліквідністю.</p> <p><i>Вміти:</i> обчислювати показники ліквідності; аналізувати їх в динаміці; робити висновки щодо виявлених тенденцій, прогнозувати їх значення на майбутнє; оцінювати потребу в ліквідних коштах; визначати нормативи ліквідності банку; визначати ефективність управління ліквідністю.</p>	<p><i>План лекції 1</i></p> <p>1. Забезпечення ліквідності у фінансових установах.</p> <p>2. Зовнішні та внутрішні чинники, що впливають на рівень ліквідності.</p> <p><i>План лекції 2</i></p> <p>1. Регулювання ліквідності органами нагляду та управління ліквідністю у фінансових установах.</p> <p>2. Стратегії та інструменти для управління ліквідністю.</p> <p>▣ Список рекомендованих джерел: <i>Нормативні джерела: 1-2, 4-12,</i> <i>Основний: 16-10</i> <i>Додатковий: 21-23, 28-29, 33</i> <i>Інтернет-ресурси: 43-53</i></p>
	<p>Самостійна робота студента</p> <p>1. Вивчення матеріалу лекції, підготовка до практичного заняття</p> <p>Питання, які виносяться на самостійне вивчення:</p> <p>1. інформаційне забезпечення управління ліквідністю у банках;</p> <p>2. інформаційне забезпечення управління ліквідністю у лізингових компаніях;</p> <p>3. інформаційне забезпечення управління ліквідністю у недержавних пенсійних фондах;</p> <p>4. інформаційне забезпечення управління ліквідністю у кредитних спілках;</p> <p>5. інформаційне забезпечення управління ліквідністю у страхових компаніях, компаніях.</p> <p>▣ Список рекомендованих джерел: <i>Нормативні джерела: 4-12,</i> <i>Основний: 16 С.24-58, 18 С. 118-153</i> <i>Додатковий: 23,30</i> <i>Інтернет-ресурси: 43,47</i></p>
	<p><i>Питання до практичного заняття 1.</i></p> <p>1. Управління ризиком незбалансованої ліквідності</p>

	<p>2. Методи оцінки потреби в ліквідних активах.</p> <p><i>Питання до практичного заняття 2.</i></p> <p>1. Управління термінами активів та зобов'язань. 2. Геп-менеджмент.</p>
<p><i>Знати:</i> сутність та послідовність управління фінансовою стійкістю та надійністю; підходи до покращення фінансовою стійкістю та надійністю; моделі оцінки вартості банку; методи управління вартістю.</p> <p><i>Вміти:</i> проводити експрес-діагностику фінансової стійкості та надійності; визначати форми фінансової та статистичної звітності, необхідні для оцінки вартості; використовувати методи оцінки вартості фінансових установ; оцінювати ефективність фінансового менеджменту.</p>	<p>ТЕМА 8. Управління фінансовою стійкістю та надійністю фінансових установ</p> <p><i>План лекції 1</i></p> <p>1. Фінансова стійкість та надійність: поняття, мета та завдання оцінки. 2. Послідовність етапів управління фінансовою стійкістю та надійністю. 3. Напрями та інструменти покращення фінансовою стійкістю та надійністю фінансово-кредитних установ.</p> <p><i>План лекції 2</i></p> <p>1. Модель фінансової рівноваги фінансово-кредитних установ. 2. Складові фінансової рівноваги. 3. Показники оцінки фінансової рівноваги.</p> <p>Список рекомендованих джерел: <i>Нормативні джерела: 1-2, 4-12, Основний: 16-10 Додатковий: 21-23, 28-29, 33, 39-42 Інтернет-ресурси: 43-53</i></p>
	<p>Самостійна робота студента</p> <p>1. Вивчення матеріалу лекції, підготовка до практичного заняття</p> <p>Питання, які виносяться на самостійне вивчення:</p> <p>1. інформаційне забезпечення управління фінансовою стійкістю і надійністю у банках; 2. інформаційне забезпечення управління фінансовою стійкістю і надійністю у лізингових компаніях; 3. інформаційне забезпечення управління фінансовою стійкістю і надійністю у недержавних</p>

	<p>пенсійних фондах;</p> <p>4. інформаційне забезпечення управління фінансовою стійкістю і надійністю у кредитних спілках;</p> <p>5. інформаційне забезпечення управління фінансовою стійкістю і надійністю у страхових компаніях, компаніях.</p> <p>▣ Список рекомендованих джерел: <i>Нормативні джерела: 4-12,</i> <i>Основний: 16 С.350-360 18 С. 898-920</i> <i>Додатковий: 23,30</i> <i>Інтернет-ресурси: 43,47</i></p>
	<p><i>Питання до практичного заняття 1.</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Фінансова стійкість та надійність: поняття, мета та завдання оцінки. 2. Умови забезпечення фінансової стійкості та надійності фінансово-кредитних установ 3. Показники оцінки фінансовою стійкістю і надійністю та їх критеріальні значення 4. Вирішення задач <p><i>Питання до практичного заняття 2.</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Модель фінансової рівноваги фінансово-кредитних установ. 2. Показники оцінки фінансової рівноваги. 3. Нормативна та динамічна моделі фінансової рівноваги.
<p><i>Знати:</i> наслідки фінансової кризи для фінансової установи; сутність та завдання антикризового фінансового управління.</p> <p><i>Вміти:</i> проводити діагностику фінансової кризи та її наслідків для фінансової установи; застосовувати інструменти антикризового фінансового управління.</p>	<p>ТЕМА 9. Антикризове управління фінансовими установами</p> <p><i>План лекції 1</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Сутність та завдання антикризового фінансового управління. 2. Діагностика фінансової кризи та її наслідків для фінансової установи. 3. Сутність та механізм превентивного антикризового менеджменту <p>▣ Список рекомендованих джерел: <i>Нормативні джерела: 1-2, 4-12,</i> <i>Основний: 16-10</i></p>

	<p>Додатковий: 21-23, 28-29, 33, 39-42 Інтернет-ресурси: 43-53</p>
	<p>Самостійна робота студента</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Вивчення матеріалу лекції, підготовка до практичного заняття. 2. Вивчити зарубіжний досвід антикризового управління у різних типах фінансових установ.
	<p><i>Питання до практичного заняття 1.</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Методи стрес-тестування кризових ситуацій. 2. Методи прогнозування банкрутства фінансово-кредитних установ. 3. Реструктуризація в системі антикризового фінансового управління фінансово-кредитними установами. <p>☞ Список рекомендованих джерел: Нормативні джерела: 4-12, Основний: 18 С. 898-920 Додатковий: 39,40 Інтернет-ресурси: 43,47,53</p>

**Курсивом виділені інтерактивні методи навчання*

СПИСОК РЕКОМЕНДОВАНИХ ДЖЕРЕЛ *

Нормативні джерела:

1. Господарський кодекс України від 16.01.2003 р. 436-IV. – Режим доступу: <http://zakon4.rada.gov.ua/laws/show/436-15>
2. Податковий кодекс України від 2.12.2010 р. № 2755–VI. – Режим доступу: <http://zakon2.rada.gov.ua/laws/show/2755-17>
3. Цивільний кодекс України від 16 січня 2003 р., № 435-IV. – Режим доступу: <http://zakon2.rada.gov.ua/laws/show/435-15>
4. Про банки і банківську діяльність: Закон України від 07.12.2000 р. № 2121-14. – Режим доступу: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/2121-14#Text>
5. Про валюту і валютні операції: Закон України від 21.06.2018 р. № 2473-VIII. – Режим доступу: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/2473-19#Text>
6. Про державне регулювання ринку цінних паперів в Україні: Закон України від 30.10.1996 р. № 448/96-ВР. – Режим доступу: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/448/96-%D0%B2%D1%80#Text>
7. Про інститути спільного інвестування: Закон України від 05.07.2012 р. № 5080-VI. – Режим доступу: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/5080-17#Text>
8. Про кредитні спілки: Закон України від 20.12.2001 р. № 2908-III. – Режим доступу: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/2908-14#Text>
9. Про страхування: Закон України від 07.03.1996 Р. № 85/96-ВР. – Режим доступу: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/2908-14#Text>
10. Про фінансові послуги та державне регулювання ринків фінансових послуг: Закон України від 12.07.2001 р. № 2664-III. – Режим доступу: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/2664-14#Text>
11. Про цінні папери та фондовий ринок: Закон України від 23.02.2006 р. № 3480-IV. – Режим доступу: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/3480-15#Text>
12. Інструкція про порядок регулювання діяльності банків в Україні: затверджена постановою Правління НБУ від 28.08.2001р. № 368. – Режим доступу: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/z0841-01#Text>
13. Методичні вказівки з інспектування банків «Система оцінки ризиків»: Затв. постановою Правління НБУ від 15.03.2004 р. № 104. – Режим доступу: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/v0104500-04#Text>
14. Положення про застосування Національним банком України стандартних інструментів регулювання ліквідності банківської системи, затвердженого постановою Правління Національного банку України від 17.09.2015 № 615 – Режим доступу: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/v0615500-15#Text>

15. Положення про порядок нагляду на консолідованій основі за небанківськими фінансовими групами, переважна діяльність у яких здійснюється фінансовими установами, нагляд за якими здійснює Національна комісія, що здійснює державне регулювання у сфері ринків фінансових послуг, затверджене розпорядженням від 12.11.2015 № 2724 – Режим доступу: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/z1511-15#Text>

Основний:

16. Бланк И.А. Основы финансового менеджмента: В 2-х т. Т.1 / И.А. Бланк. – 4-е изд.; перераб. и доп. – М.: Омега-Л, 2012. – 656с.

17. Бланк И.А. Основы финансового менеджмента: В 2-х т. Т.2 / И.А. Бланк. – 4-е изд.; перераб. и доп. – М.: Омега-Л, 2012. – 674с

18. Бригхэм Ю. Финансовый менеджмент / Ю. Бригхэм, М. Эрхардт; пер. с англ. под ред. Е. А. Дорофеева. – СПб. : Питер, 2007. – 960 с. : ил. – (Серия «Академия финансов»).

19. Лачкова В. М. Фінансовий менеджмент у банку: навч. посібник / В. М. Лачкова, Л. І. Лачкова, І. Л. Шевчук. – Х.: 2017. – 180 с.

20. Примостка Л.О. Фінансовий менеджмент у банку : Підручник. – 3-ге вид., допов. і перероб. – К.: КНЕУ, 2012. – 338 с.

Додатковий:

21. Банківський менеджмент: питання теорії та практики: монографія / [О. А. Криклій та ін.]. - Суми : ДВНЗ "УАБС НБУ", 2011. - 152 с.

22. Банковский менеджмент учеб. пособие / Н.И. Куликов, И.Р. Унанян, Л.С. Тишина. – Тамбов : Изд-во ГОУ ВПО ТГТУ, 2010. – 80 с.

23. Банковский менеджмент: учебник / кол. авторов под ред.О.И.Лаврушина. – 3-е изд., перераб. и доп. – М.: КНОРУС, 2010. – 560 с.

24. Боди З., Кейн А., Маркус А. Принципы инвестиций; пер. с англ. – 4-е изд. – М.: Вильямс, 2004. – 984 с.

25. Газман В. Д. Ценообразование лизинга : учеб. пособие для вузов / В. Д. Газман. – М. : Изд. Дом ГУ ВШЭ, 2006. – 543, [1] с.

26. Горемыкин В. А. Лизинг : учебник / В. А. Горемыкин. – Изд. 2-е, исправленное и дополненное. – М. : Информационно-издательский дом «Филин»; Информцентр XXI века, 2006. – 944 с. – ISBN 5-9216-0056-3. – ISBN 5-94361-138-X

27. Дзюблюк О. Роль банківської системи в інноваційному розвитку економіки [Електронний ресурс] / О. Дзюблюк // Вісник Тернопільського національного економічного університету. - 2019. - Вип. 1. - С. 81-101.

28. Д'яконова І. І. Методологічні основи формування системи фінансового менеджменту банку: монографія / І. І. Д'яконова. - Суми : Університетська книга, 2012. - 117 с.
29. Івасів І. Б. Оцінка можливостей впровадження Базель III щодо відновлення діяльності неплатоспроможних банків [Електронний ресурс] / І. Б. Івасів, О. О. Тараленко // Молодий вчений. - 2019. - № 2(2). - С. 619-624.
30. Кононец О. Організаційна структура лізингової компанії / Олексій Кононец // Лізинг в Україні. – 2006. – №3. – С. 15-17.
31. Кравченко Ю.Я. Ринок цінних паперів : Навч. посібник / – К. : КНТ, 2009. – 672 с.
32. Криклій О. А. Управління кредитним ризиком банку : монографія / О. А. Криклій, Н. Г. Маслак. - Суми : ДВНЗ "УАБС НБУ", 2008. - 86 с.
33. Кричевский М.Л. Финансовые риски : учебное пособие / М.Л. Кричевский. – М. : КНОРУС, 2012 – 248 с.
34. Маслак Н. Г. Ціноутворення на банківські продукти]: монографія/ Н. Г. Маслак, О. А. Криклій. - Суми : ДВНЗ "УАБС НБУ", 2010. – 121 с.
35. Плісак Т.О., Гагаріна С.А., Недеря Л.В., Нетребчук Л.О. Облік та аналіз діяльності комерційного банку: Навч.посібник для студентів вищих навч.закладів: У 2 - х кн..Кн.1. - К.: КНТЕУ, 2004. - 515 с.
36. Плісак Т.О., Гагаріна С.А., Недеря Л.В., Нетребчук Л.О. Облік та аналіз діяльності комерційного банку: Навч.посібник для студентів вищих навч.закладів: У 2 - х кн..Кн.2 – К.: КНТЕУ, 2003. – 308 с.
37. Посібник з лізингу : навчальний посібник / Д. О. Богодухов, С. П. Кисіль, Ю. М. Луців [та ін.] ; за ред. Л. Я. Снігір. – К. : ТОВ «Поліграф плюс», 2009. – 392 с.
38. Технологія лізингу : монографія / Н. Рязанова, Р. Іваненко, Л. Стасюк [та ін.] ; за ред. Г. Т. Сенькович. – К. : ЦНТ «Гопак», 2010. – 320 с.
39. Черкашина К.Ф. Застосування інноваційних інструментів ефективного менеджменту при злитті чи поглинанні як перспективного напрямку у подоланні кризових явищ у банківському секторі/ К.Ф. Черкашина // Формування ринкових відносин в Україні – 2020. № 6 (229). С. 59-67.
40. Черкашина К.Ф. Ефективність державного регулювання та нагляду за небанківськими фінансово-кредитами установами / К.Ф. Черкашина // Modern Economics. – 2018. №11. С. 154-159.
41. Чмутова, І. М. Аналіз банківської діяльності: навч. посіб. – Харків : ХНЕУ, 2012. – 307 с

42. Фінансове планування і управління на підприємствах: навчальний посібник / Г. А. Семенов, В. З. Бугай, А. Г. Семенов, А. В. Бугай.– К. : Центр учбової літератури, 2007. – 432 с.

Інтернет-ресурси:

43. Агентство з розвитку інфраструктури фондового ринку України. – Режим доступу: <http://www.smida.gov.ua/>

44. Всеукраїнський депозитарій цінних паперів. – Режим доступу: <http://www.ausd.com.ua/>

45. Міжнародна організація комісій з цінних паперів (IOSCO). – Режим доступу: <http://www.iosco.org>

46. Національна комісія з цінних паперів та фондовому ринку. – Режим доступу: <https://www.nssmc.gov.ua/>

47. Національний банк України. – Режим доступу: <http://www.bank.gov.ua/>

48. Національний депозитарій України. – Режим доступу: <http://www.ndu.gov.ua/>

49. Офіційна веб-сторінка Базельського комітету по банківському нагляду. – Режим доступу : www.bis.org

50. Офіційний сайт Державної служби статистики України – Режим доступу : <http://www.ukrstat.gov.ua/>.

51. Перша фондова торгова система. – Режим доступу: www.pfts.com

52. Українська біржа. – Режим доступу: <http://ux.com.ua/s65>

53. Фонд гарантування вкладів фізичних осіб – Режим доступу: <https://www.fg.gov.ua/>