

# УПРАВЛІННЯ БІРЖОВИМИ РИЗИКАМИ

## **Викладач:**

Кузьменко О.Б., Фертікова Т.М.

## **Отримані навички:**

- ✓ Вміти адаптуватися та проявляти ініціативу і самостійність в ситуаціях, які виникають в професійній діяльності.
- ✓ Застосовувати бізнес-комунікації для підтримки взаємодії з представниками різних професійних груп.
- ✓ Оцінювати продукцію, товари, послуги, а також процеси, що відбуваються в підприємницьких, торговельних та/або біржових структурах, і робити відповідні висновки для прийняття управлінських рішень.
- ✓ Вміти вирішувати проблемні питання, що виникають в діяльності підприємницьких, торговельних та/або біржових структур за умов невизначеності та ризиків.
- ✓ Впроваджувати інноваційні проекти з метою створення умов для ефективного функціонування та розвитку підприємницьких, торговельних та/або біржових структур.
- ✓ Вміти розробляти і впроваджувати проекти для виконання управлінських рішень щодо фінансово-економічних результатів і ризиків діяльності підприємства.

**Обсяг:** 5 кредити (150 годин) ECTS, з яких 96 годин самостійної роботи.

**Мета:** набуття студентами теоретичних знань щодо біржових ризиків та отримання практичних навичок реалізації заходів щодо його зниження. Вивчення дисципліни передбачає формування теоретичних знань та практичних навичок у системі оцінки ступеня біржового ризику та вибору оптимальних інструментів для його зниження до мінімально можливого рівня.

## **Тематика курсу:**

Тема 1. Біржові ризики – сутність, види, класифікація

Тема 2. Похідні фінансові інструменти - сутність, види, роль у хеджуванні ризиків

Тема 3. Хеджування за допомогою форвардних контрактів

Тема 4. Хеджування за допомогою ф'ючерсних контрактів

Тема 5. Хеджування за допомогою свопів

Тема 6. Хеджування за допомогою опціонів

Тема 7. Особливості застосування інструментів хеджування ризиків на різних видах бірж

Тема 8. Оптимальна поведінка в умовах ризику учасника біржових торгів

Тема 9. Оптимізація рівня ризику учасника торгів на фондових біржах

# УПРАВЛІННЯ БІРЖОВИМИ РИЗИКАМИ

## *Обсяг та види робіт:*

За семестр: 60 балів

За іспит: 40 балів

## *Види робіт:*

- ✓ тести – 20\*1 бал = 20 балів;
- ✓ опитування – 15\*1 балу = 15 балів;
- ✓ розв'язання задач – 8 \*2 бали = 16 балів;
- ✓ аналітична робота – 9 балів.

**Технічні вимоги:** Проекційне мультимедійне обладнання (проектор, екран, ноутбук/комп'ютер);

Доступ до мережі Internet, точка доступу Wi-Fi;

OS: Windows, Android, iOS;

Browsers: Chrome / Opera / Mozilla Firefox / MS Edge;

Програмне забезпечення: GantProject, Word, Excel, PowerPoint; Skype, Zoom, Google Meet;

Демо-версії навчальних електронних біржових платформ та відкриті бази біржових даних;

Система електронного навчання Moodle 3.9

**Академічна доброчесність:** передбачає самостійне виконання запропонованих видів робіт; у разі наявності текстових збігів, копіювання, списування або фальсифікації даних робота не зараховується.

## *Вимоги до робіт:*

- ✓ актуальність тематики, відповідність її сучасному стану певної галузі;
- ✓ вивчення та критичний аналіз наукової і періодичної літератури з теми;
- ✓ вивчення та характеристику історії досліджуваної проблеми та її практичного стану, а також передового (при наявності - й власного) досвіду;
- ✓ наявність чіткої характеристики об'єкта, предмета, мети і завдань, методів дослідження, опис та аналіз проведених автором емпіричних досліджень;
- ✓ узагальнення результатів, обґрунтування їх, висновки та практичні рекомендації.