



МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ЦЕНТРАЛЬНОУКРАЇНСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ
ТЕХНІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ

Кафедра фінансів, банківської справи та страхування



СИЛАБУС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Назва курсу	Банківський менеджмент
Викладач	Валерій Подплетній, кандидат економічних наук, доцент, доцент кафедри фінансів, банківської справи та страхування
Контактний тел.	+38(050) 757-82-87
E-mail:	podpletniyv@ukr.net
Обсяг та ознаки дисципліни	Вибіркова дисципліна, змістових модулів – 2. Форма контролю: залік. Загальна кількість кредитів – 4, годин – 120, у т.ч. лекції – 28 годин, практичні заняття – 14 годин, самостійна робота – 78 годин. Формат: очний (offline / face to face) / дистанційний (online). Мова викладання: українська / англійська. Рік викладання – 2022.
Консультації	Консультації проводяться відповідно до Графіку, розміщеному в інформаційному ресурсі moodle.kntu.kr.ua; у режимі відеоконференцій Zoom, через електронну пошту, Viber, Messenger, Telegram за домовленістю.
Пререквізити	Вивчення даної дисципліни вимагає від студентів обізнаності з матеріалом, викладеним у дисциплінах “Фінансовий менеджмент”, “Банківські операції”, “Банківська система”

1. Мета і завдання дисципліни

Метою вивчення дисципліни “Банківський менеджмент” є формування у студентів системи знань з теорії та практики управління фінансовими потоками, активами та пасивами, прибутковістю та ризиками банку; вміння використовувати й адаптувати отримані знання до конкретних виробничих ситуацій.

Завдання дисципліни спрямовані на формування у студентів **компетентності** щодо: сутності, цілей та методологічних засад фінансового менеджменту банку; особливостей організаційної побудови та системи управління банком; планування в системі управління банком; усвідомлення

необхідності системного підходу до управління ризиками та прибутковістю, активами, зобов'язаннями, капіталом і позабалансовою діяльністю банку; ефективного використання інструментів фінансового управління діяльністю банку.

2. Результати навчання

У результаті вивчення навчальної дисципліни здобувач вищої освіти повинен

знати:

- особливості управління фінансовими ресурсами банківських установ;
- методику управління активами та пасивами банку;
- варіанти управлінських рішень у сфері фінансів, банківської справи та страхування та оцінювати їх ефективність з урахуванням цілей, наявних обмежень, законодавчих та етичних аспектів

вміти:

- використовувати фундаментальні закономірності розвитку фінансів, банківської справи та страхування у поєднанні з дослідницькими і управлінськими інструментами для здійснення професійної та наукової діяльності;
- використовувати теоретичний та методичний інструментарій для діагностики і моделювання фінансової діяльності суб'єктів господарювання;
- застосовувати управлінські навички у сфері фінансів, банківської справи та страхування;
- розробляти технічні завдання для проектування інформаційних систем у сфері фінансів, банківської справи та страхування.

набути соціальних навичок (soft-skills):

- здійснювати професійну комунікацію, ефективно пояснювати і презентувати матеріал;
- взаємодіяти в економічному середовищі.

3. Політика курсу та академічна доброчесність

Очікується, що здобувачі вищої освіти будуть дотримуватися принципів академічної доброчесності, усвідомлювати наслідки її порушення.

При організації освітнього процесу в Центральноукраїнському національному технічному університеті здобувачі вищої освіти, викладачі та адміністрація діють відповідно до: Положення про організацію освітнього процесу; Положення про організацію вивчення вибіркового навчальних дисциплін та формування індивідуального навчального плану ЗВО; Кодексу академічної доброчесності ЦНТУ.

4. Програма навчальної дисципліни

Тема 1. Теоретичні засади менеджменту в банку.

Тема 2. Управління ризиками в банку.

Тема 3. Стратегічне управління та планування в банку.

Тема 4. Управління капіталом банку.

Тема 5. Управління зобов'язаннями банку.

Тема 6. Менеджмент кредитного портфеля банку.

Тема 7. Менеджмент портфеля цінних паперів банку.

Тема 8. Управління активами і пасивами банку.

Тема 9. Управління ліквідністю банку.

Тема 10. Хеджування ризиків у банку.

5. Система оцінювання та вимоги

Види контролю: поточний, підсумковий.

Методи контролю: спостереження за навчальною діяльністю здобувачів, усне опитування, письмовий контроль.

Рейтинг студента із засвоєння дисципліни визначається за 100 бальною шкалою, у тому числі: перший рубіжний – 50 балів, другий рубіжний контроль – 50 балів.

Семестровий екзамен полягає в оцінці рівня засвоєння здобувачем вищої освіти навчального матеріалу на лекційних, практичних, семінарських або лабораторних заняттях і виконання індивідуальних завдань за п'ятибальною та стобальною шкалою ЄКТС результатів навчання.

6. Рекомендована література

1. Банківський менеджмент: інноваційні концепції та моделі: моногр./ За заг. ред. проф. Л.О. Примостки. К.: КНЕУ, 2017. 380 с.

2. Довгань Ж.М. Менеджмент у банку: підруч. Тернопіль: Економічна думка, 2017. 512 с.

3. Електронний словник Національного банку України. Офіційний сайт Національного банку України. URL: <https://bank.gov.ua/control/uk/pubNsh/artide?artId=32278664&catId=32278660>

4. Жердецька Л.В. Системний банківський ризик: причини та напрями регулювання: моногр. Одеса: Видавництво «Атлант», 2017. 353 с.

5. Зверяков М.І. Управління фінансовою стійкістю банків: підручник / М.І. Зверяков, В.В. Коваленко, О.С. Сергеева. Одеса: Видавництво «Атлант», 2014. 485 с.

6. Зверяков М.І. Антикризове управління фінансовою стійкістю банку в умовах економічних дисбалансів: монографія / М.І. Зверяков, О.М. Зверяков. Одеса : ОНЕУ, 2015. 418 с.

7. Інструкція про порядок регулювання діяльності банків в Україні, затверджена Постановою Правління Національного банку України від 28.08.2001, №368 (зі змінами та доповненнями). URL: <http://zakon2.rada.gov.ua/laws/show/z0841-01>.

8. Підходи НБУ до стрес-тестування банків у 2018 році. URL: <https://bank.gov.ua/doccatalog/document?id=65952478>

9. Методичні вказівки з інспектування банків «Система оцінки ризиків», схвалені Постановою Правління Національного банку України 15.03.2004 р., №104. URL: <http://zakon3.rada.gov.ua/laws/show/v0104500-04>

10. Методичні рекомендації щодо організації та функціонування систем ризик-менеджменту в банках України, схвалені Постановою Правління Національного банку України № 361 від 02.08.2004р. (зі змінами та доповненнями). URL: <http://zakon2.rada.gov.ua/laws/show/v0361500-04/page>.

11. Порядок визначення та затвердження рейтингової оцінки банку за рейтинговою системою CAMELSO, схваленого Рішенням Правління Національного банку України 01.11.2016р., №393-рш. URL: <https://bank.gov.ua/document/download;jsessionid=6E5C04F213A141F657B968AF7A21039A?docId=40919990>.

12. Постанова Правління Національного банку України «Про затвердження Положення про визначення банками України розміру кредитного ризику за активними банківськими операціями» від 30.06.2016 р. № 351. URL: <http://zakon0.rada.gov.ua/laws/show/v0351500-16>

13. Постанова Правління Національного банку України «Про особливості здійснення оцінки стійкості банків і банківської системи України у 2018 році» №94 від 14 серпня 2018 року. URL: <http://zakon.rada.gov.ua/laws/show/en/v0094500-18>

14. Сокиринська І.Г., Журавльова Т.О. Фінансовий менеджмент у банку. навч. посіб. Дніпропетровськ : Пороги, 2016. 192 с.

15. Фінансовий менеджмент у банку: підручник / Л. О. Примостка. 3-тє вид., доп. і перероб. К.: КНЕУ, 2012. 338 с.

16. Basel III: Finalising post-crisis reforms. December 2017. Available at:

17. <https://www.bis.org/bcbs/publ/d424.pdf>

18. Basel Committee on Banking Supervision. Global systemically important banks: assessment methodology and the additional loss absorbency requirement. July 2013. Available at: <http://www.bis.org/publ/bcbs255.htm>

19. Börner C.J. Strategisches Bankmanagement: Ressourcen- und marktorientierte Strategien von Universalbanken, München / Wien, 2000. 479 p.

20. Büschgen H. Bankbetriebslehre: Bankgeschäfte und Bankmanagement. Fifth Edition. 5 Auflage, Wiesbaden, 2014.

21. Rolfes, B. Gesamtbanksteuerung: Risiken ertragsorientiert steuern, 2008. 619 p.

Розглянуто і схвалено на засіданні кафедри фінансів, банківської справи та страхування, Протокол №1 від 30 серпня 2022 р.