Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Крылова Людмила Вячеславовна
Должность: Проректор по учебно-методической работе
Дата подписания: 10.11.2026 20:46:32
Уникальный программный ключ:
b066544bae1e449cd8bfee392f7224a676a27102

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Донецкий национальный университет экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского»

КАФЕДРА БАНКОВСКОГО ДЕЛА

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по учебно-методической работе



_____ Л.В. Крылова
(подпись) (фамилия, инициалы)
«25» 03 2026 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
Б1.В.05 ФИНАНСОВЫЙ МЕНЕДЖМЕНТ В БАНКЕ

(шифр, название дисциплины)

Укрупненная группа направлений подготовки: 38.00.00 Экономика и управление
(код, наименование)

Образовательная Программа высшего образования: программа магистратуры

Направление подготовки: 38.04.08 Финансы и кредит
(код, наименование)

Магистерская программа: Банковское дело
(код, наименование)

Институт: учета и финансов

Форма обучения, курс: очная форма обучения, 2 курс
заочная форма обучения, 2 курс

Рабочая программа адаптирована для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов (*при наличии таких лиц*)

Донецк
2026

Рабочая программа дисциплины «Финансовый менеджмент в банке»» для обучающихся по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит, магистерской программе: Банковское дело разработана в соответствии с ОПОП ВО для набора обучающихся 2026 года.

Разработчик: Грицак Елена Владимировна, доцент кафедры банковского дела, кандидат экономических наук, доцент

Рабочая программа утверждена на заседании кафедры банковского дела
Протокол от 10 февраля 2026 года № 11

Зав. кафедрой

КАФЕДРА БАНКОВСКОГО ДЕЛА

_____ И.В. Попова
(подпись) (фамилия, инициалы)

СОГЛАСОВАНО
Директор института учета и финансов

_____ Л.И. Тымчина
(подпись) (фамилия. инициалы)

24 февраля 2026 года

ОДОБРЕНО

Учебно-методическим советом ФГБОУ ВО «ДОННУЭТ»

Протокол от 25 марта 2026 года № 8

Председатель _____ Л.В. Крылова
(подпись) (фамилия, инициалы)

© Грицак Е.В., 2026 год
© Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Донецкий национальный университет экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского», 2026 год

1. ОПИСАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

<table>
<tr><td rowspan="2">Наименование показателя</td><td rowspan="2">Наименование укрупненной группы направлений подготовки, направление подготовки, магистерская программа, программа высшего образования</td><td colspan="2">Характеристика дисциплины</td></tr>
<tr><td>очная форма обучения</td><td>заочнаяформа обучения</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Количество зачетных единиц – 2</td><td>Укрупненная группа направлений подготовки 38.00.00 Экономика и управление</td><td colspan="2" rowspan="2">Часть, формируемая участниками образовательных отношений</td></tr>
<tr><td>Направление подготовки 38.04.08 Финансы и кредит</td></tr>
<tr><td>Модулей – 1</td><td rowspan="5">Магистерская программа: Банковское дело</td><td colspan="2">Год подготовки</td></tr>
<tr><td>Смысловых модулей – 3</td><td>2-й</td><td>2-й</td></tr>
<tr><td rowspan="3">Общее количество часов – 72</td><td colspan="2">Семестр</td></tr>
<tr><td>3-й</td><td>Зимняя сессия</td></tr>
<tr><td colspan="2">Лекции</td></tr>
<tr><td rowspan="11">Количество часов в неделю для очной формы обучения: аудиторных – 1,92; самостоятельной работы обучающегося – 0,4</td><td rowspan="11">Программа высшего образования – программа магистратуры</td><td>16 часов</td><td>6 часов</td></tr>
<tr><td colspan="2">Практические, семинарские занятия</td></tr>
<tr><td>16 часов</td><td>6 часов</td></tr>
<tr><td colspan="2">Лабораторные занятия</td></tr>
<tr><td>-</td><td>-</td></tr>
<tr><td colspan="2">Самостоятельная работа</td></tr>
<tr><td>6,8 часов</td><td>45,7 часов</td></tr>
<tr><td colspan="2">Форма промежуточной аттестации</td></tr>
<tr><td>экзамен</td><td>экзамен</td></tr>
</table>

Соотношение количества часов аудиторных занятий и самостоятельной работы составляет:
для очной формы обучения – 32 /6,8;
для заочной формы обучения – 12 /45,7

2. ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель дисциплины:

формирование у обучающихся системы знаний по теории и практике управления финансовыми потоками, активами и пассивами, доходностью и рисками банка, навыков по разработке управленческих решений по эффективному формированию и использованию финансовых ресурсов в банке.

Задачи дисциплины: приобретение профессиональных компетенций в области управления финансами банков и их отдельными составляющими для решения задач профессиональной деятельности, связанных с оценкой финансово-экономических рисков, составлением и обоснованием прогнозов основных финансово-экономических показателей деятельности банковских учреждений, планированием, прогнозированием и формированием структуры оптимального портфеля банка, применением методов управления кредитными рисками, риском ликвидности банка, процентным и валютным рисками банка.

3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП ВО

Дисциплина Б1.В.05 «Финансовый менеджмент в банке» относится к дисциплинам части ОПОП ВО, формируемой участниками образовательных отношений

Связь с другими дисциплинами (практиками) учебного плана:

- изучение данной дисциплины базируется на знаниях следующих дисциплин: «Актуальные проблемы финансов», «Финансовый менеджмент», «Система риск-менеджмента в банках», «Кредитование как банковский бизнес-процесс», «Инвестиционная деятельность банков», «Семинар «Актуальные вопросы теории и практики банковского дела»;

- данная дисциплина является основополагающей для изучения следующих дисциплин (практик): «Производственная практика по профилю профессиональной деятельности».

4. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ), СООТНЕСЕННЫХ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

В результате освоения дисциплины у обучающегося должны быть сформированы компетенции и индикаторы их достижения:

Код и наименование компетенции	*Код и наименование индикатора достижения компетенции*
ПК-1. Способен провести анализ и дать оценку существующих финансово-экономических рисков, составить и обосновать прогноз динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро- и мезоуровне	ИДК-1$_{ПК-1}$ Оценивает влияние управленческих решений на рост стоимости организации и увеличение прибыли ИДК-2$_{ПК-1}$ Разрабатывает финансовую политику и выбирает эффективные варианты управленческих решений
ПК-3. Способен планировать, прогнозировать и формировать структуру оптимального портфеля банка	ИДК-4$_{ПК-3}$ Разрабатывает стратегии управления капиталом банка на основе регламентирующих правил и нормативных актов
ПК-5. Способен осуществлять управление риском ликвидности банка, процентным и валютным рисками	ИДК-1$_{ПК-5}$ Определяет возможность размещения активов на срочных фондовых и товарных рынках, оценивает условия и осуществляет выбор финансовых инструментов

В результате изучения дисциплины обучающийся должен:

знать: цели и задачи, составные части финансового менеджмента в банке; этапы процесса управления финансовыми потоками в банке, особенности и виды финансовых планов; стратегии и методы управления ресурсами, активами банка и их отдельными составляющими (капиталом, обязательствами, кредитным портфелем и портфелем ценных бумаг); инструментарий интегрированного управления активами и пассивами банка и сферу их применения, хеджирования банковских рисков;

уметь: обосновывать оптимальную политику управления банковскими ресурсами, доходностью и рисками банка; организовывать процесс управления финансовыми потоками; обосновывать оптимальные варианты формирования ресурсной базы, доходных и качественных портфелей банка (кредитного, ценных бумаг); обоснованно применять методы интегрированного управления активами и пассивами банка для обеспечения оптимального соотношения между прибыльностью и уровнем рисков;

владеть: инструментарием финансового менеджмента; методикой диагностики финансового состояния банка с учетом приемлемого риска и достижения конечных целей финансовой стратегии банка; методами управления капиталом, обязательствами, кредитным портфелем; портфелем ценных бумаг банка; методами интегрированного управления активами и пассивами банка (сроками активов и обязательств, гэпом, дюрацией); методами хеджирования финансовых рисков, управления ликвидностью банка.

5. ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

МОДУЛЬ 1. ФИНАНСОВЫЙ МЕНЕДЖМЕНТ В БАНКЕ

Смысловой модуль 1. Сущность, роль и функции финансового менеджмента в банке.

Тема 1. Теоретические и организационные основы финансового менеджмента в банке.

Тема 2. Финансовое планирование банковской деятельности.

Смысловой модуль 2. Содержание и методы управления традиционными сферами банковской деятельности.

Тема 3. Менеджмент капитала банка.

Тема 4. Управление обязательствами банка.

Тема 5. Менеджмент кредитного портфеля банка.

Тема 6. Менеджмент портфеля ценных бумаг.

Смысловой модуль 3. Современные подходы к эффективному управлению финансами банка.

Тема 7. Управление активами и пассивами банка.

Тема 8. Хеджирование рисков в банке.

Тема 9. Управление ликвидностью банка.

6. СТРУКТУРА ДИСЦИПЛИНЫ

Название смысловых модулей и тем	Количество часов											
	очная форма						заочная форма					
	всего	в том числе					всего	в том числе				
		л[1]	п[2]	лаб[3]	СР[4]	Пр[5]		л[1]	п[2]	лаб[3]	СР[4]	Пр[5]
1	*2*	*3*	*4*	*5*	*6*	*7*	*8*	*9*	*10*	*11*	*12*	*13*
Модуль 1. Финансовый менеджмент в банке												
Смысловой модуль 1. Сущность, роль и функции финансового менеджмента в банке												
Тема 1. Теоретические и организационные основы финансового менеджмента в банке	2,7	1	1	-	0,7	-	6	0,5	0,5		5	-
Тема 2. Финансовое планирование банковской деятельности	2,7	1	1	-	0,7	-	5	-	-		5	-
Всего по смысловому модулю 1	***5,4***	***2***	***2***	***-***	***1,4***	***-***	***11***	***0,5***	***0,5***		***10***	***-***
Смысловой модуль 2. Содержание и методы управления традиционными сферами банковской деятельности												
Тема 3. Менеджмент капитала банка	4,8	2	2	-	0,8	-	7	1	1		5	-
Тема 4. Управление обязательствами банка	4,7	2	2	-	0,7	-	7	1	1		5	-
Тема 5. Менеджмент кредитного портфеля банка	4,8	2	2	-	0,8	-	7	1	1		5	-
Тема 6. Менеджмент портфеля ценных бумаг	4,8	2	2	-	0,8	-	6	0,5	0,5		5	-
Всего по смысловому модулю 2	***19,1***	***8***	***8***	***-***	***3,1***	***-***	***27***	***3,5***	***3,5***		***20***	***-***

Название смысловых модулей и тем	Количество часов											
	очная форма						заочная форма					
	всего	в том числе					всего	в том числе				
		л[1]	п[2]	лаб[3]	СР[4]	Пр[5]		л[1]	п[2]	лаб[3]	СР[4]	Пр[5]
1	*2*	*3*	*4*	*5*	*6*	*7*	*8*	*9*	*10*	*11*	*12*	*13*
Смысловой модуль 3. Современные подходы к эффективному управлению финансами банка												
Тема 7. Управление активами и пассивами банка	4,8	2	2	-	0,8	-	7	1	1		5	-
Тема 8. Хеджирование рисков в банке	4,7	2	2	-	0,7	-	5	-	-		5	-
Тема 9. Управление ликвидностью банка	4,8	2	2	-	0,8	-	7,7	1	1		5,7	-
Всего по смысловому модулю 3	***14,3***	***6***	***6***	**-**	***2,3***	**-**	***19,7***	***2***	***2***		***15,7***	-
Всего часов	**38,8**	**16**	**16**		**6,8**		**57,7**	**6**	**6**		**45,7**	**-**
ИК	1					1	1					1
Катт	2,8					2,8	2,9					2,9
СРэк	-					-	-					-
КЭ	2					2	2					2
Каттэк	0,4					0,4	0,4					0,4
Контроль	27					27	8					8
Итого	**72**	**16**	**16**	**-**	**6,8**	**33,2**	**72**	***6***	***6***		**45,7**	**14,3**

Примечания: 1. л – лекции;
2. п – практические (семинарские) занятия;
3.лаб – лабораторные занятия;
4.СР – самостоятельная работа;
5.Пр – прочие виды работы (ИК, Катт, КЭ, Каттэк)
6.ИК – индивидуальные консультации;
7.Катт – контактная работа на аттестацию в период теоретического обучения;
8.СРэк – самостоятельная работа в период экзаменационных сессий;
9.КЭ – консультации перед экзаменом
10.Каттэк – контактная работа на аттестацию в период экзаменационных сессий.

7. ТЕМЫ СЕМИНАРСКИХ И ПРАКТИЧЕСКИХ ЗАНЯТИЙ

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	заочная форма
Смысловой модуль 1. Сущность, роль и функции финансового менеджмента в банке			
1	Тема 1. Теоретические и организационные основы финансового менеджмента в банке	1	0,5
2	Тема 2. Финансовое планирование банковской деятельности	1	-
Смысловой модуль 2. Содержание и методы управления традиционными сферами банковской деятельности			
3	Тема 3. Менеджмент капитала банка	2	1

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	заочная форма
4	Тема 4. Управление обязательствами банка	2	1
5	Тема 5. Менеджмент кредитного портфеля банка	2	1
6	Тема 6. Менеджмент портфеля ценных бумаг	2	0,5
Смысловой модуль 3. Современные подходы к эффективному управлению финансами банка			
7	Тема 7. Управление активами и пассивами банка	2	1
8	Тема 8. Хеджирование рисков в банке	2	-
9	Тема 9. Управление ликвидностью банка	2	1
Всего:		16	6

8. ТЕМЫ ЛАБОРАТОРНЫХ ЗАНЯТИЙ – не предусмотрены

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	заочная форма
1	*2*	*3*	*4*
Всего:			

9. САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	заочная форма
Смысловой модуль 1. Сущность, роль и функции финансового менеджмента в банке			
1	Тема 1. Теоретические и организационные основы финансового менеджмента в банке	0,7	5
2	Тема 2. Финансовое планирование банковской деятельности	0,7	5
Смысловой модуль 2. Содержание и методы управления традиционными сферами банковской деятельности			
3	Тема 3. Менеджмент капитала банка	0,8	5
4	Тема 4. Управление обязательствами банка	0,7	5
5	Тема 5. Менеджмент кредитного портфеля банка	0,8	5
6	Тема 6. Менеджмент портфеля ценных бумаг	0,8	5
Смысловой модуль 3. Современные подходы к эффективному управлению финансами банка			
7	Тема 7. Управление активами и пассивами банка	0,8	5
8	Тема 8. Хеджирование рисков в банке	0,7	5
9	Тема 9. Управление ликвидностью банка	0,8	5,7
Всего:		6,8	45,7

10. ОБЕСПЕЧЕНИЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ДЛЯ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ И ИНВАЛИДОВ

В ходе реализации дисциплины используются следующие дополнительные методы обучения, текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся в зависимости от их индивидуальных особенностей:

1) для слепых и слабовидящих:

- лекции оформляются в виде электронного документа, доступного с помощью компьютера со специализированным программным обеспечением;
- письменные задания выполняются на компьютере со специализированным программным обеспечением или могут быть заменены устным ответом;
- при необходимости предоставляется увеличивающее устройство; возможно также использование собственных увеличивающих устройств;
- письменные задания оформляются увеличенным шрифтом;

2) для глухих и слабослышащих:

- лекции оформляются в виде электронного документа, либо предоставляется звукоусиливающая аппаратура индивидуального пользования;
- письменные задания выполняются на компьютере в письменной форме;
- экзамен проводится в письменной форме на компьютере; возможно его проведение в форме тестирования;

3) для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

- лекции оформляются в виде электронного документа, доступного с помощью компьютера со специализированным программным обеспечением;
- письменные задания выполняются на компьютере со специализированным программным обеспечением;
- экзамен проводится в устной форме или выполняется в письменной форме на компьютере.

При необходимости предусматривается увеличение времени для подготовки ответа.

Процедура проведения экзамена для обучающихся устанавливается с учетом их индивидуальных психофизических особенностей.

Экзамен может проводиться в несколько этапов.

При проведении процедуры оценивания результатов обучения предусматривается использование технических средств, необходимых в связи с индивидуальными особенностями обучающихся. Технические средства могут быть предоставлены ФГБОУ ВО «ДОННУЭТ», а также могут использоваться собственные технические средства.

Проведение процедуры оценивания результатов обучения допускается с использованием дистанционных образовательных технологий.

Обеспечивается доступ к информационным и библиографическим ресурсам в информационно-телекоммуникационной сети Интернет для каждого обучающегося в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

1) для слепых и слабовидящих:

- в печатной форме увеличенным шрифтом;
- в форме электронного документа;
- в форме аудиофайла.

2) для глухих и слабослышащих:

- в печатной форме;
- в форме электронного документа;

3) для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

- в печатной форме;
- в форме электронного документа;
- в форме аудиофайла.

11.СИСТЕМА ОЦЕНИВАНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Оценочные средства детализируются по видам работ в оценочных материалах по дисциплине, которые утверждаются на заседании кафедры.

Система оценивания по дисциплине, изучаемой в очной форме обучения[1]

Форма контроля	**Максимальное количество баллов**	
	За одну работу	**Всего**
Текущий контроль:		
- собеседование (темы 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9)	1	9
- тестирование (темы 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9)	1	9
- разноуровневые задачи и задания (темы 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9)	1	9
- текущий модульный контроль 1	5	5
- текущий модульный контроль 2	5	5
- текущий модульный контроль 3	3	3
Промежуточная аттестация	экзамен	60
Итого за семестр	100	

Примечание. В соответствии с утвержденными оценочными материалами по дисциплине

Система оценивания по дисциплине, изучаемой в заочной форме обучения

Форма контроля	**Максимальное количество баллов**	
	За одну работу	**Всего**
Текущий контроль:		
- тестирование	3	27
- контрольная работа	13	13
Промежуточная аттестация	экзамен	60
Итого за семестр	100	

Типовые вопросы к экзамену:

1. Сущность финансового менеджмента в банке и его место в системе банковского менеджмента.
2. Направления банковского менеджмента.
3. Объекты и основные функции финансового менеджмента в банке.
4. Инструментарий финансового менеджмента в банке.
5. Виды планирования банковской деятельности.
6. Сущность, состав и функции капитала банка.
7. Главная цель и объекты управления банковским капиталом.
8. Методы оценивания стоимости банковского капитала.
9. Методы определения и регулирования достаточности банковского капитала.
10. Экономические нормативы капитала банков.
11. Метод внутренних источников пополнения капитала банка. Реинвестирование прибыли банка.
12. Сущность дивидендной политики банка и е типы.
13. Метод внешних источников пополнения капитала банка.
14. Эмиссия акций банками в форме ПАО как источник пополнения капитала, преимущества, и недостатки.
15. Управление привлеченными средствами банка.
16. Управление заимствованными средствами банка.
17. Внебалансовые источники ресурсов банка.
18. Сущность, цель и объекты управления кредитным портфелем банка.
19. Экономические нормативы кредитного риска банков.
20. Факторы, которые влияют на формирование кредитных ставок.
21. Плата за кредит и методы ценообразования по банковским кредитам.
22. Методы ценообразования по кредитам и определения доходности кредитного портфеля банка.
23. Системы начисления процентов по кредитам.

24. Методы управления риском на уровне отдельного кредита.
25. Методы управления риском на уровне кредитного портфеля.
26. Показатели оценки качества, доходности и эффективности управления кредитным портфелем банка.
27. Методы управления проблемными кредитами.
28. Портфель ценных бумаг: сущность, особенности, состав, функции, цель и объекты управления.
29. Понятие полезности ценных бумаг банка.
30. Основные подходы к управлению портфелем ценных бумаг банка: пассивная и активная инвестиционная политика.
31. Классификация портфелей ценных бумаг банка.
32. Показатели дохода и доходности портфеля ценных бумаг.
33. Характеристики ценной бумаги: номинал, себестоимость, справедливая стоимость, ставка (норма) доходности, рыночная стоимость, внутренняя стоимость.
34. Методы определения внутренней стоимости ценных бумаг разных видов.
35. Характеристика видов портфелей ценных бумаг в зависимости от избранной инвестиционной политики: активные и пассивные портфели ценных бумаг.
36. Характеристика видов портфелей ценных бумаг в зависимости от задач в процессе формирования портфеля: портфель роста, портфель дохода, портфель рискового капитала, сбалансированный портфель, специализированный портфель.
37. Экономические нормативы инвестирования банков.
38. Риск портфеля ценных бумаг и показатели его оценки: стандартное отклонение, дисперсия, коэффициент бета, ковариация.
39. Понятие несистемного и системного риска портфеля ценных бумаг, диверсифицированного и недиверсифицированного портфеля ценных бумаг.
40. Показатели оценки эффективности управления портфелем ценных бумаг банка: коэффициент Трейнора, коэффициент Шарпа.
41. Понятие инвестиционного горизонта портфеля ценных бумаг банка и стратегии управления им: стратегия равномерного распределения, стратегия долгосрочного акцента, стратегия «штанги», стратегия процентных ожиданий.
42. Инструменты управления инвестиционным горизонтом портфеля ценных бумаг банка: кривая доходности, дюрация.
43. Подходы к управлению активами и пассивами банка.
44. Сущность стратегии управления пассивами банка.
45. Сущность стратегии управления активами банка.
46. Особенности интегрированного подхода к управлению активами и пассивами банка (ИУАП), классификация методов ИУАП.
47. Управление сроками активов и обязательств банка с помощью показателя чистого спрэда.
48. Управление гэпом.
49. Управление дюрацией.
50. Сущность валютного риска и управление валютной позицией банка.
51. Финансовые деривативы, их виды и операции с ними.
53. Подходы и методы управления ликвидностью банка.

12. РАСПРЕДЕЛЕНИЕ БАЛЛОВ, КОТОРЫЕ ПОЛУЧАЮТ ОБУЧАЮЩИЕСЯ

Максимальное количество баллов за текущий контроль и самостоятельную работу									**Максимальная сумма баллов**		
Смысловой модуль 1		Смысловой модуль 2				Смысловой модуль 3			**Текущий контроль**	**Экзамен**	**Все виды учебной деятельности**
Т1	Т2	Т3	Т4	Т5	Т6	Т7	Т8	Т9			
6	5	5	4	4	4	4	4	4			

Примечание. Т1, Т2,Т3, Т4, Т5, Т6, Т7, Т8, Т9 – номера тем соответствующих смысловых модулей

Курсовая работа

Основная часть, балл	Оформление, балл	Защита работы, балл	Максимальная сумма баллов
до 20 баллов	до 20 баллов	до 60 баллов	100

Государственная шкала оценивания академической успеваемости

Сумма баллов за все виды учебной деятельности	По государственной шкале
90-100	5 «отлично»
75-89	4 «хорошо»
60-74	3 «удовлетворительно»
менее 60	2 «неудовлетворительно»

13. РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА

Основная литература:

1.Финансовый и банковский менеджмент : учебник / Я.Ю. Радюкова, О.Н. Чернышова, А.Ю. Федорова [и др.]. — Москва : ИНФРА-М, 2023. — 421 с. — (Среднее профессиональное образование). — DOI 10.12737/1123729. - ISBN 978-5-16-016825-8. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.ru/catalog/product/1123729 (дата обращения: 04.02.2026).

2. Синки, Дж. Финансовый менеджмент в коммерческом банке и в индустрии финансовых услуг : практическое руководство / Дж. Синки-мл. — Москва : Альпина Паблишер , 2026 . — 1018 с. - ISBN 5-9614-0344. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.ru/catalog/product/2231520 (дата обращения: 04.02.2026).

3. Управление банковскими рисками : учебник / Е. В. Бережная, С. В. Зенченко, М. В. Сероштан, О. В. Бережная. - 2-е изд. - Москва : Дашков и К, 2022. - 180 с. - ISBN 978-5-394-04941-5. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/2084824 (дата обращения: 04.02.2026).

Дополнительная литература:

1. Энциклопедия финансового риск-менеджмента : энциклопедия / под ред. канд. экон. наук А. А. Лобанова и А. В. Чугунова. — 4-е изд., испр. и доп. - Москва : Альпина Паблишер, 2026. - 932 с. - ISBN 978-5-9614-0824-9. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.ru/catalog/product/2235109 (дата обращения: 04.02.2026).

2. Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент : учебник / А. Н. Фомичев. - 10-е изд. - Москва : Дашков и К, 2023. - 366 с. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.ru/catalog/product/2084174 (дата обращения: 04.02.2026).

1. Антонов, Г. Д. Управление рисками организации : учебник / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. — Москвуа : ИНФРА-М, 2026. — 153 с. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.ru/catalog/product/2221567 (дата обращения: 04.02.2026).

3. Латышева, Л. А. Финансовый риск-менеджмент : учебное пособие / Л. А. Латышева, Ю. М. Склярова, И. Ю. Скляров ; под общ. ред. Л. А. Латышевой. – 2-е изд., доп. и перераб. – Ставрополь : Ставропольский государственный аграрный университет, 2024. - 401 с. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.ru/catalog/product/2234182 (дата обращения: 04.02.2026). .

Учебно-методические издания:

1. Грицак, Е. В. Финансовый менеджмент в банке [Текст] : конспект лекций для обучающихся по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (Магистерская программа: Банковское дело). — Донецк : [ДонНУЭТ], 2025 . — Учебно-методический комплекс дисциплины.

2. Грицак, Е. В. Финансовый менеджмент в банке [Текст] : методические рекомендации для проведения практических и семинарских занятий для обучающихся по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (Магистерская программа: Банковское дело) . — Донецк : [ДонНУЭТ], 2025 . — Учебно-методический комплекс дисциплины.

3. Грицак, Е. В. Финансовый менеджмент в банке [Текст] : методические рекомендации для организации самостоятельной работы для обучающихся по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (Магистерская программа: Банковское дело) . — Донецк : [ДонНУЭТ], 2025 . — Учебно-методический комплекс дисциплины.

4. Грицак, Е. В. Финансовый менеджмент в банке [Текст] : средства диагностики знаний для обучающихся по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (Магистерская программа: Банковское дело) . — Донецк : [ДонНУЭТ], 2025 . - Учебно-методический комплекс дисциплины.

5. Финансовый менеджмент в банке. Методические указания к выполнению курсовой работы для студентов направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (Магистерская программа: Банковское дело), очной и заочной формы обучения [Текст] / ГО ВПО «Донец. нац. ун-т экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского», ин-т учета и финансов, каф. банк. дела: И.В. Попова, Е.В. Грицак – Донецк: [ДонНУЭТ], 2025 - Учебно-методический комплекс дисциплины.

14. ИНФОРМАЦИОННЫЕ РЕСУРСЫ

1.Автоматизированная библиотечная информационная система Unilib UC : версия 2.110 // Научная библиотека Донецкого национального университета экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского. – [Донецк, 2021–]. – Текст : электронный.

2.Электронный каталог Научной библиотеки Донецкого национального университета экономики и торговли им. Михаила Туган-Барановского. – Донецк : НБ ДОННУЭТ, 1999– . – URL:http://catalog.donnuet.ru. – Текст : электронный.

3.Автоматизированная интегрированная библиотечная система (АИБС) «МегаПро». – Москва : ООО «Дата Экспресс», 2025– . – Текст : электронный.

4.IPR SMART : весь контент ЭБС Ipr books : цифровой образовательный ресурс / ООО «Ай Пи Эр Медиа». – Саратов : Ай Пи Эр Медиа, 2007 –. – URL:http://www.iprbookshop.ru. – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст. Аудио. Изображения : электронные.

5.Лань : электронная-библиотечная система. – Санкт-Петербург : Лань, cop. 2011–2025. – URL:https://e.lanbook.com/ – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст : электронный.

6.СЭБ : Консорциум сетевых электронных бибилиотек / Электронная-библиотечная система «Лань» при поддержке Агентства стратегических инициатив. – Санкт-Петербург : Лань, cop. 2011–2025. – URL:https://seb.e.lanbook.com/ – Режим доступа : для пользователей организаций – участников, подписчиков ЭБС «Лань». – Текст : электронный.

7.Polpred : электронная библиотечная система : деловые статьи и интернет-сервисы / ООО «Полпред Справочники». – Москва : Полпред Справочники, cop. 1997–2025. – URL:https://polpred.com. – Текст : электронный.

8.Book on lime : дистанционное образование : электронная библиотечная система / издательство КДУ МГУ им. М.В. Ломоносова. – Москва : КДУ, cop. 2017 –. – URL:https://bookonlime.ru. – Текст . Изображение. Устная речь : электронные.

9.Информио : электронный справочник / ООО «РИНФИЦ». – Москва : Издательский дом «Информио», 2009 –. – URL: https://www.informio.ru. – Текст : электронный.

10.Университетская библиотека онлайн : электронная библиотечная система. – ООО «Директ-Медиа», 2006–. – URL:https://biblioclub.ru/ – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст : электронный.

11.Научно-информационный библиотечный центр имени академика Л.И. Абалкина / Российский экономический унтиниверситет имени В.Г. Плеханова. – Москва : KnowledgeTree Inc., 2008– . – URL:http://liber.rea.ru/login.php. – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст : электронный.

12.Библиотечно-информационный комплекс / Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации. – Москва : Финансовый университет, 2019– . – URL:http://library.fa.ru/ – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст : электронный.

13.Зональная научная библиотека имени Ю.А. Жданова / Южный федеральный университет. – Ростов-на-Дону : Южный федеральный университет, 2016 – . – URL:https://library.lib.sfedu.ru/ – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст : электронный.

14.Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU: информационно- аналитический портал / ООО Научная электронная библиотека. – Москва : ООО Научная электронная библиотека, cop. 2000–2025. – URL:https://elibrary.ru. – Режим доступа: для зарегистрированных пользователей. – Текст : электронный.

15.CYBERLENINKA : Научная электронная библиотека «КиберЛенинка» / [Е. Кисляк, Д. Семячкин, М. Сергеев ; ООО «Итеос»]. – Москва : КиберЛенинка, 2012 – . – URL:http://cyberleninka.ru. – Текст : электронный.

16.Национальная электронная библиотека : НЭБ : федеральная государственная информационная система / Министерство культуры Российской Федерации [и др.]. – Москва ; Российская государственная библиотека : ООО ЭЛАР, [2008 –]. – URL:https://rusneb.ru/ – Текст. Изображение : электронные.

15. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Минимально необходимый для реализации ОПОП магистратуры перечень материально-технического обеспечения включает аудиторный фонд в соответствии с утвержденным расписанием с использованием мультимедийного демонстрационного комплекса кафедры банковского дела (проектор, ноутбук).

16. КАДРОВОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Фамилия, имя, отчество	Условия привлечения (по основному месту работы, на условиях внутреннего/ внешнего совместительства;на условиях договора гражданско-правового характера (далее – договор ГПХ)	Должность, ученая степень, ученое звание	Уровень образования, наименование специальности, направления подготовки, наименование присвоенной квалификации	Сведения о дополнительном профессиональном образовании[1]
Грицак Елена Владимировна	По основному месту работы	Должность - доцент, кандидат экономических наук, ученое звание - доцент	Высшее, электрические станции, инженер-электрик, диплом кандидата наук КД № 071517	1. Удостоверение о повышении квалификации 612400036359, рег. № 1-19349 от 08.09.2023 г. «Организационно-методические аспекты разработки и реализации прогнрамм высшего образования по направлениям подготовки

Фамилия, имя, отчество	Условия привлечения (по основному месту работы, на условиях внутреннего/ внешнего совместительства;на условиях договора гражданско-правового характера (далее – договор ГПХ)	Должность, ученая степень, ученое звание	Уровень образования, наименование специальности, направления подготовки, наименование присвоенной квалификации	Сведения о дополнительном профессиональном образовании[1]
				Экономика и управление», 36 часов, ФГБОУ ВО «Донской государственный технический университет, г. Ростов-на-Дону (08-10.09.2023 г.). 2. Удостоверение о повышении квалификации 7220240338468, «Методика антикоррупционного просвещения и воспитания в организациях высшего образования (для педагогических работников», 18 часов, ФГАОУ ВО «Тюменский государственный университет», г. Тюмень (25-30.11.2024 г.).

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ Б1.В.05 ФИНАНСОВЫЙ МЕНЕДЖМЕНТ В БАНКЕ

Направление подготовки 38.04.08 Финансы и кредит
Магистерская программа: Банковское дело
Трудоемкость дисциплины: 2 з.е.

Планируемые результаты обучения по дисциплине:

знать: цели и задачи, составные части финансового менеджмента в банке; этапы процесса управления финансовыми потоками в банке, особенности и виды финансовых планов; стратегии и методы управления ресурсами, активами банка и их отдельными составляющими (капиталом, обязательствами, кредитным портфелем и портфелем ценных бумаг); инструментарий интегрированного управления активами и пассивами банка и сферу их применения, хеджирования банковских рисков;

уметь: обосновывать оптимальную политику управления банковскими ресурсами, доходностью и рисками банка; организовывать процесс управления финансовыми потоками; обосновывать оптимальные варианты формирования ресурсной базы, доходных и качественных портфелей банка (кредитного, ценных бумаг); обоснованно применять методы интегрированного управления активами и пассивами банка для обеспечения оптимального соотношения между прибыльностью и уровнем рисков;

владеть: инструментарием финансового менеджмента; методикой диагностики финансового состояния банка с учетом приемлемого риска и достижения конечных целей финансовой стратегии банка; методами управления капиталом, обязательствами, кредитным портфелем; портфелем ценных бумаг банка; методами интегрированного управления активами и пассивами банка (сроками активов и обязательств, гэпом, дюрацией); методами хеджирования финансовых рисков, управления ликвидностью банка.

Компетенции выпускников и индикаторы их достижения

Код и наименование компетенции	*Код и наименование индикатора достижения компетенции*
ПК-1. Способен провести анализ и дать оценку существующих финансово-экономических рисков, составить и обосновать прогноз динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро- и мезоуровне	ИДК-1$_{ПК-1}$ Оценивает влияние управленческих решений на рост стоимости организации и увеличение прибыли ИДК-2$_{ПК-1}$ Разрабатывает финансовую политику и выбирает эффективные варианты управленческих решений
ПК-3. Способен планировать, прогнозировать и формировать структуру оптимального портфеля банка	ИДК-4$_{ПК-3}$ Разрабатывает стратегии управления капиталом банка на основе регламентирующих правил и нормативных актов
ПК-5. Способен осуществлять управление риском ликвидности банка, процентным и валютным рисками	ИДК-1$_{ПК-5}$ Определяет возможность размещения активов на срочных фондовых и товарных рынках, оценивает условия и осуществляет выбор финансовых инструментов

Смысловые модули и темы дисциплины:

Смысловой модуль 1. Сущность, роль и функции финансового менеджмента в банке. Тема 1. Теоретические и организационные основы финансового менеджмента в банке. Тема 2. Финансовое планирование банковской деятельности.

Смысловой модуль 2. Содержание и методы управления традиционными сферами банковской деятельности. Тема 3. Менеджмент капитала банка. Тема 4. Управление

обязательствами банка. Тема 5. Менеджмент кредитного портфеля банка. Тема 6. Менеджмент портфеля ценных бумаг.

Смысловой модуль 3. Современные подходы к эффективному управлению финансами банка. Тема 7. Управление активами и пассивами банка. Тема 8. Хеджирование рисков в банке. Тема 9. Управление ликвидностью банка.

Форма промежуточной аттестации: экзамен

Разработчик:
Грицак Е.В., кандидат экономических наук, доцент _____
(подпись)

Заведующий кафедрой банковского дела
Попова И.В., доктор экономических наук, доцент _____
(подпись)