

**Силабус навчальної дисципліни
«Фінансова та банківська ризикологія»**

Ступінь вищої освіти – доктор філософії

Рік навчання: 2, Семестр: 3

Кількість кредитів: 5

Мова викладання: українська

Підсумковий контроль: диференційований залік

Форма проведення занять: лекції, семінарські заняття

Назва курсу	Фінансова та банківська ризикологія
Електронна версія курсу	https://moodle.dpu.edu.ua/course/view.php?id=1306

Коротка анотація до курсу:

Дисципліна «Фінансова та банківська ризикологія» спрямована на набуття теоретичного та практичного підґрунтя для ефективного проведення досліджень щодо якісного та кількісного аналізу ризиків у фінансово-кредитній сфері; що забезпечить формування вмінь та навичок щодо його застосування у роботі з управління фінансовими та банківськими ризиками.

1. Схема дисципліни (приклад)

№ з/п	Тема
Тема 1	Концептуальні засади ризик-менеджменту в фінансово-кредитній сфері
Тема 2	Банківські ризики: сутність, чинники, класифікація
Тема 3	Система кількісних показників фінансових ризиків
Тема 4	Методи та моделі кількісного аналізу ризиків у фінансово-кредитній сфері
Тема 5	Методи зниження ризиків у фінансово-кредитній сфері
Тема 6	Врахування ризиків у прийнятті рішень в банківництві

2. Формат курсу:

Змішаний

3. Компетентності, які мають бути сформовані у результаті опанування навчальної дисципліни

Інтегральна компетентність: здатність розв'язувати комплексні проблеми в галузі професійної та/або дослідницько-інноваційної діяльності, що передбачає глибоке

переосмислення наявних та створення нових цілісних концептуальних та методологічних знань та/або професійної практики у сфері фінансів, банківської справи, страхування та фондового ринку чи на межі галузей знань або професійної діяльності.

Загальні компетентності:

- Здатність до започаткування, планування, реалізації та коригування послідовного процесу ґрунтовного наукового дослідження з дотриманням належної академічної доброчесності, пошуку, оброблення та аналізу інформації з різних джерел з відповідним критичним аналізом, оцінкою і синтезом нових і комплексних ідей.
- Здатність до мотивації та досягнення спільної мети із безперервним саморозвитком та самовдосконаленням.

Спеціальні (фахові, предметні) компетентності (СК):

- Здатність обирати методи, необхідні для досягнення поставленої мети дослідження.
- Здатність до виконання наукових досліджень у сфері фінансів, банківської справи та страхування на відповідному фаховому рівні, досягнення наукових результатів, що створюють нові знання, для розв'язання актуальних проблем.
- Здатність вибудовувати ефективну систему управління фінансовими ризиками економічних суб'єктів, застосовувати моделі, методи та інструменти фінансового ризик-менеджменту, розробляти механізми управління фінансовими ризиками на макро-, мезо- та мікрорівнях.

4. Результати навчання:

- Здійснювати повний та різносторонній пошук інформації, її систематизацію та аналіз.
- Обирати методи для проведення досліджень у сфері фінансів, банківської справи та страхування, що забезпечують досягнення поставленої мети.
- Виконувати оригінальні наукові дослідження у сфері фінансів, банківської справи та страхування на відповідному фаховому рівні, досягати наукових результатів, що створюють нові знання, для розв'язання актуальних проблем.
- Бути спроможним реалізовувати проекти, включаючи результати власних досліджень, спрямовані на вирішення актуальних проблем у сфері фінансів, банківської справи та страхування.

5. Обсяг курсу

Вид заняття	Загальна кількість годин
Лекції	26
Семінарські заняття	24
Самостійна робота	100

Технічне й програмне забезпечення /обладнання – ТП EXCEL

Неформальна освіта *(зазначити передбачена чи не передбачена)*

6. Політика оцінювання

Політика щодо дедлайнів та перескладання: Завдання, які виконуються із порушенням термінів без поважних причин, оцінюються на нижчу оцінку (-1 бал). Перескладання модулів відбувається із дозволу адміністрації факультету за наявності поважних причин (наприклад, лікарняний).

Політика щодо академічної доброчесності: письмові роботи перевіряються на наявність плагіату і допускаються до захисту із коректними текстовими запозиченнями не

більше 20%. Списування під час контрольних робіт та екзаменів заборонені (в т.ч. із використанням мобільних девайсів).

7.Рекомендована література

Основна

1. Кравченко М.О., Бояринова К.О., Копішинська К.О. Управління ризиками: навчальний наочний посібник. Київ: КПП ім. Ігоря Сікорського, 2021. 432.
2. Лактіонова О. А. Управління фінансовими ризиками. Вінниця: ДонНУ, 2020. 256 с.
3. Стешенко О. Д. Ризикологія: Навч. посібник. Харків: УкрДУЗТ, 2019. 180с.
4. Шклярчук С. Г. Управління фінансовими ризиками: навч. посіб. / С. Г. Шклярчук. — Київ : ДП «Вид. дім «Персонал», 2019. 494 с.

Додаткова

5. Дронь М. А. Облік і управління фінансовими ризиками банку в умовах економічної нестабільності. Наукові та прикладні аспекти обліково-аналітичного забезпечення ризик-орієнтованого управління : колективна монографія / Під заг. ред В. В. Бобиля. – Дніпро : Видавець Біла К. О., 2021. – С. 31–59.
6. Пернарівський О., Підсосонна Я. Селективні ризики вкладників вітчизняних банків в умовах воєнного стану. Науково-виробничий журнал «Бізнес-навігатор». 2024. Випуск 3(76), 111-115. Режим доступу: http://business-navigator.ks.ua/journals/2024/76_2024/21.pdf
7. Пернарівський О., Татяніна С. Принципи та стан формування інформаційних систем управління ризиками в банках України. Східна Європа: економіка, бізнес та управління. 2018. №4(15). URL: http://easterneurope-ebm.in.ua/journal/15_2018/64.pdf
8. Шульга Н.П. Інтегрована система управління ризиками банку: монографія / за заг. ред. Н.П. Шульги. Київ : КНТЕУ, 2018. 440 с.
9. Шишкіна О. Термінологічні проблеми пізнання природи фінансового ризику. Проблеми і перспективи економіки та управління. 2019. № 1 (17). – С. 253–264.
10. Prymostka, L. O., Prymostka, O. O. (2019). РИЗИК-ОРІЄНТОВАНЕ УПРАВЛІННЯ БАНКОМ. Financial and Credit Activity Problems of Theory and Practice, 2(29), 66–72. URL: <https://doi.org/10.18371/fcaptop.v2i29.172224>
11. Doroshenko, N., Kulyk, N., Pohorelenko, A. (2021). BANKING RISKS IN UKRAINE AND METHODS OF THEIR PREVENTION. Social Economics, (62), 138-147. <https://doi.org/10.26565/2524-2547-2021-62-13>
12. Drobyazko S.; Bondarevska O.; Klymenko D.; Pletenetska S.; Pylypenko O. MODEL FOR FORMING OF OPTIMAL CREDIT PORTFOLIO OF COMMERCIAL BANK. // Journal of Management Information and Decision Sciences; Volume 22, Issue 4 (2019). P. 501-506.

Міжнародні видання

13. Altunbaş, Y., Thornton, J., & Uymaz, Y. (2021). Money laundering and bank risk: Evidence from U.S. banks. International Journal of Finance and Economics, 26(4), 4879–4894.
14. Kazbekova, K., Adambekova, A., Baimukhanova, S., Kenges, G., & Bokhaev, D. (2020). Bank risk management in the conditions of financial system instability. Entrepreneurship and Sustainability Issues, 7(4), 3269–3285.

15. Polizzi S, Scannella E (2020) An empirical investigation into market risk disclosure: Is there room to improve for Italian banks? *J Financ Regul Compl* 28(3):465–483
16. Sharma A, Theresa L, Mhatre J, Sajid M (2019) Application of altman Z-Score to RBI defaulters: Indian case. *Asian J Res Bus Econ Manag* 9(4):1–11

Інформаційні ресурси ІНТЕРНЕТ

17. Верховна Рада України. URL: <http://www.rada.gov.ua>
18. Національна комісія з цінних паперів та фондового ринку. URL: <http://www.nssmc.gov.ua>.
19. Офіційний сайт НБУ: bank.gov.ua
20. Офіційний сайт Мінфіну України: minfin.gov.ua