

## Силабус навчальної дисципліни

### «Фінансова ризикологія»

Ступінь вищої освіти – доктор філософії

Рік навчання: 2, Семестр: 3

Кількість кредитів: 5 (150)

Мова викладання: українська

Підсумковий контроль: диференційований залік

Форма проведення занять: лекції, семінарські заняття

|                         |                                                                                                                   |
|-------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Назва курсу             | Фінансова ризикологія                                                                                             |
| Електронна версія курсу | <a href="https://moodle.dpu.edu.ua/course/view.php?id=1306">https://moodle.dpu.edu.ua/course/view.php?id=1306</a> |

#### Коротка анотація до курсу:

Дисципліна «Фінансова 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 ризиками.

#### 1. Схема дисципліни

| № з/п  | Тема                                                                     |
|--------|--------------------------------------------------------------------------|
| Тема 1 | Концептуальні засади ризик-менеджменту в фінансово-кредитній сфері       |
| Тема 2 | Фінансові 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 управлінських фінансових рішень           |

#### 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 до впровадження результатів власних досліджень у сфері фінансів, банківської справи, страхування та фондового ринку.

#### **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** – ноутбуки, планшети, смартфони, ТП EXCEL

**Неформальна освіта** 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. Лактіонова О. А. Управління фінансовими ризиками. Вінниця: ДонНУ, 2020. 256 с.
2. Долінський Л. Б. Фінансовий ризик-менеджмент : навч.-метод. посібник. – Київ : Національний університет «Києво-Могилянська академія», 2022. – 132 с.
3. Кравченко М.О., Бояринова К.О., Копішинська К.О. Управління ризиками: навчальний наочний посібник. Київ: КПП ім. Ігоря Сікорського, 2021. 432 с.

### **Допоміжна**

4. 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.
5. Пернарівський, О. (2025). VAR-ТЕХНОЛОГІЯ ОЦІНКИ ВАЛЮТНОГО РИЗИКУ БАНКУ. Сталій розвиток економіки, 3 (54), 396-401. <https://doi.org/10.32782/2308-1988/2025-54-60>
6. 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.
7. 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>
8. 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.
9. 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.
10. 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

### **Інформаційні ресурси ІНТЕРНЕТ**

11. Верховна Рада України. URL: <http://www.rada.gov.ua>
12. Національна комісія з цінних паперів та фондового ринку. URL: <http://www.nssmc.gov.ua>.
13. Офіційний сайт НБУ: [bank.gov.ua](http://bank.gov.ua)
14. Офіційний сайт Мінфіну України: [minfin.gov.ua](http://minfin.gov.ua)