

Код та назва дисципліни українською мовою/ Назва дисципліни англійською мовою	2-ф06-05 Управління ризиками криптовалютного портфелю / Risk Management of a Cryptocurrency Portfolio
Рекомендується для галузі знань (спеціальності, освітньої програми)	Для спеціальностей усіх галузей знань
Кафедра (зазначати повну назву кафедри)	Економіки, підприємництва та управління підприємствами
П.І.П. НПП (за можливості)	
Рівень ВО	другий (магістерський)
КУРС, семестр (в якому буде викладатись)	
Мова викладання	Українська
Пререквізити (передумови вивчення дисципліни)	Не передбачено
Чому це цікаво/треба вивчати	Формування у студентів комплексного розуміння специфіки ризиків на криптовалютному ринку, опанування методів їх ідентифікації, оцінки та мінімізації, розвиток навичок побудови диверсифікованих криптовалютних портфелів з оптимальним співвідношенням доходності та ризику. Дисципліна є особливо актуальною в умовах стрімкого розвитку цифрових активів та необхідності професійного підходу до інвестування в криптовалютному просторі
Перелік тем з дисципліни	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Типологія та класифікація ризиків криптовалютного портфелю.</li> <li>2. Ринкові ризики: волатильність, кореляція, ліквідність криптоактивів.</li> <li>3. Технологічні ризики: вразливості блокчейн-мереж, атаки 51%, масштабованість.</li> <li>4. Регуляторні ризики: міжнародні та національні підходи до регулювання криптовалют.</li> <li>5. Операційні ризики: безпека зберігання, кіберзагрози, шахрайство.</li> <li>6. Кількісні методи оцінки ризиків: VAR, Sharpe Ratio, Maximum Drawdown.</li> <li>7. Диверсифікація криптовалютного портфелю: стратегії та методи оптимізації.</li> <li>8. Хеджування ризиків за допомогою деривативів та кореляційних стратегій.</li> <li>9. On-chain аналіз для оцінки ризиків криптовалютних інвестицій.</li> <li>10. Побудова стресостійких криптопортфелів для різних ринкових циклів.</li> </ol>
Як можна користуватися набутими знаннями і уміннями (компетентності)	Отримані знання та уміння дадуть змогу розробляти комплексні стратегії управління ризиками при інвестуванні в криптовалюту, будувати збалансовані криптовалютні портфелі з урахуванням індивідуального ставлення до ризику, застосовувати сучасні аналітичні інструменти для оцінки

	потенційних загроз, ефективно реагувати на зміни ринкової кон'юнктури, забезпечувати захист цифрових активів від різноманітних загроз
Очікувані результати навчання	Студенти зможуть ідентифікувати та класифікувати специфічні ризики криптовалютного ринку, застосовувати різноманітні кількісні та якісні методи для їх оцінки, впроваджувати диверсифікаційні стратегії для оптимізації співвідношення ризику і доходності, використовувати інструменти технічного та фундаментального аналізу для прийняття обґрунтованих інвестиційних рішень, розробляти індивідуальні системи ризик-менеджменту для різних типів криптовалютних інвесторів
Інформаційне забезпечення	Наукові публікації, опорний конспект лекцій, методичні вказівки, електронні ресурси
Види навчальних занять ( <i>лекції, практичні, семінарські, лабораторні заняття тощо</i> )	Лекції, практичні заняття
Вид семестрового контролю	диференційований залік
Максимальна кількість здобувачів на семестр/ Мінімальна кількість здобувачів ( <i>тільки для мовних, творчих дисциплін, за необхідності</i> )	Без обмежень

Декан факультету \_\_\_\_\_ *Тетяна ГРИНЬКО*