

	СИЛАБУС НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ «ПРИКЛАДНА СТАТИСТИКА У ФІНАНСОВІЙ СФЕРІ»
Галузь знань	D «Бізнес, адміністрування та право»
Спеціальність	D 2 «Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок»
Освітньо-професійна програма	«Фінанси, банківська справа та страхування»
Рівень вищої освіти	Другий (магістерський)
Назва кафедри	Статистики та математичних методів в економіці
Тип дисципліни	Обов'язкова
Семестр	Другий
Мова викладання	Українська
Керівник курсу	Голубова Галина Володимирівна , кандидат економічних наук, доцент, доцент кафедри статистики та математичних методів в економіці
Профайл керівника курсу	http://nasoa.edu.ua/spivrobotnyky/golubova-galyna-volodymyrivna/
Контактна інформація керівника курсу (e-mail), сторінка курсу в Moodle	HHolubova@nasoa.edu.ua https://dist.nasoa.edu.ua/course/view.php?id=1129
Передумови для вивчення навчальної дисципліни	Наявність систематичних та ґрунтовних знань з компонентів професійної підготовки освітньої програми, зокрема «Ринок фінансових послуг», «Фінансовий менеджмент підприємств», «Управління публічними фінансами», «Страховий бізнес».

ОПИС ДИСЦИПЛІНИ

Обсяг	Кредитів ECTS	Годин	За видами занять:					
			Лекцій	Практ. занять	Лабор. занять	Індив.-консульт.	Сам. підготовка	Вид підсумкового контролю
	Денна форма навчання							
	4	120	20	22			78	Екзамен
	Заочна форма							
	4	120	2	4			114	Екзамен

Опис дисципліни	Навчальна дисципліна «Прикладна статистика у фінансовій сфері» є обов'язковою компонентою навчального плану. Мета вивчення навчальної дисципліни полягає у формуванні у здобувачів вищої освіти системи сучасних знань, умінь і практичних
------------------------	---

	навичок застосування методів прикладної статистики для аналізу, прогнозування та обґрунтування управлінських рішень у сфері фінансів, банківської справи та страхування. Вивчення дисципліни спрямоване на розвиток здатності використовувати статистичні інструменти для оцінювання фінансових процесів, управління ризиками, діагностики стану фінансових установ та забезпечення стійкого функціонування фінансової системи в умовах невизначеності та динамічних змін. Завдання вивчення навчальної дисципліни: ознайомлення здобувачів із сучасними підходами та методами прикладної статистики у фінансовій сфері; формування навичок збору, систематизації та обробки фінансово-економічної інформації з використанням статистичних методів та інформаційно-аналітичних систем; засвоєння методів статистичного аналізу фінансових ринків, банківських і страхових операцій, а також оцінки ефективності управлінських рішень; вивчення інструментарію моделювання, прогнозування та ризик-менеджменту у фінансовій сфері; розвиток здатності критично оцінювати результати статистичних досліджень і використовувати їх для обґрунтування стратегічних і тактичних рішень у фінансовій діяльності; набуття практичних навичок роботи з програмним забезпеченням, що застосовується у фінансово-статистичних дослідженнях; формування аналітичного мислення та компетентності у сфері прикладної статистики для вирішення професійних завдань у фінансових установах. Формат проведення дисципліни: лекції, практичні (семінарські) заняття, самостійна робота. Здобувачі вищої освіти мають змогу отримати індивідуальні консультації.
Професійні компетентності	ЗК 3. Здатність проведення досліджень на відповідному рівні. СК 2. Здатність використовувати теоретичний та методичний інструментарій для діагностики і моделювання фінансової діяльності суб'єктів господарювання. СК 6. Здатність застосовувати міждисциплінарні підходи при розв'язанні складних задач і проблем у сфері фінансів, банківської справи, страхування та фондового ринку. СК 7. Здатність до пошуку, використання та інтерпретації інформації, необхідної для вирішення професійних і наукових завдань в сфері фінансів, банківської справи, страхування та фондового ринку. СК 9. Здатність розробляти технічні завдання для проектування інформаційних систем у сфері фінансів, банківської справи, страхування та фондового ринку. СК 11. Здатність застосовувати методи прикладної статистики та інноваційні підходи для обґрунтування управлінських рішень у розв'язанні складних фінансових завдань.
Програмні результати навчання	ПР 04. Відшуковувати, обробляти, систематизувати та аналізувати інформацію, необхідну для вирішення професійних та наукових завдань в сфері фінансів, банківської справи, страхування та фондового ринку. ПР 10. Здійснювати діагностику і моделювання фінансової діяльності суб'єктів господарювання. ПР 15. Застосовувати методи прикладної статистики та інноваційні підходи для аналізу, прогнозування та обґрунтування управлінських рішень у сфері фінансів, банківської справи, страхування та

	фондового ринку.
Тематика навчальної дисципліни	Змістовий модуль 1. Теоретико-методологічні основи прикладної статистики у фінансах Тема 1. Предмет, метод і завдання прикладної статистики у фінансовій сфері. Джерела статистичної інформації. Тема 2. Статистичні показники у фінансових дослідженнях: абсолютні, відносні та середні величини, індексний метод. Тема 3. Методи аналізу динаміки та варіації фінансових процесів. Тема 4. Кореляційно-регресійний аналіз у дослідженні фінансових залежностей. Змістовий модуль 2. Прикладні методи статистичного аналізу у банківській, страховій та інвестиційній діяльності Тема 5. Статистичний аналіз банківської діяльності: ресурси, кредити, депозити. Тема 6. Статистика страхового ринку: премії, виплати, фінансова стійкість страховиків. Тема 7. Методи прогнозування та оцінювання ризиків на фінансових ринках.
Методи навчання	Для досягнення навчальних цілей, розвитку аналітичних здібностей і професійної підготовки здобувачів освіти передбачається застосування різноманітних методів навчання, зокрема: - словесні (лекція, бесіда, пояснення, дискусія); - наочні (ілюстрація статистичних матеріалів, демонстрація програмних продуктів, презентація результатів досліджень); - практичні (розв'язання статистичних задач, збирання і оброблення фінансових даних, застосування економіко-статистичних методів, робота з програмним забезпеченням Excel, STATISTICA тощо); - репродуктивні та продуктивні (виконання розрахункових завдань, дослідницькі й пошукові проекти, індивідуальні кейс-завдання з фінансової статистики); - стимулювання та мотивації навчання (моделювання фінансових ситуацій, аналіз кейсів з практики фінансових установ); - контролю і самоконтролю (усні та письмові перевірки, тестування, виконання практичних завдань у Moodle, підготовка аналітичних звітів).
Матеріально-технічне забезпечення навчальної дисципліни	Комп'ютери з програмним забезпеченням для виконання різних видів освітньої діяльності: Microsoft Office, STATISTICA, веб-браузери. Мультимедійний проектор, персональний комп'ютер або ноутбук, використання платформи Microsoft Teams та Moodle для дистанційного навчання.
Політики навчальної дисципліни	Політика щодо академічної доброчесності. Дотримання академічної доброчесності здобувачами вищої освіти НАСОН є передумовою для ефективного опанування результатами навчання і отримання позитивної оцінки з поточного та підсумкового контролів. Складові політики академічної доброчесності регламентуються: Положенням про академічну доброчесність Національної академії статистики, обліку та аудиту, затвердженим рішенням Вченої ради НАСОН, протокол від 24 квітня 2020 р. № 8. Відповідно до Положення про внутрішню систему забезпечення якості освіти в НАСОН та Положення про академічну доброчесність

	у НАСОА у разі виявлення викладачем порушення студентом норм та правил академічної доброчесності, викладач зобов'язаний застосувати норми п.11.8.3 Положення про внутрішню систему забезпечення якості освіти в НАСОА, зокрема: «повторне проходження оцінювання (тест, контрольна робота, залік, іспит тощо); повторне проходження відповідного освітнього компонента (модуля) освітньої програми» Політика щодо відвідування занять. Здобувачі вищої освіти денної форми навчання зобов'язані відвідувати заняття. Поважними причинами для відсутності на заняттях є хвороба, академічна мобільність або інші випадки відсутності, які підтверджені документально. Якщо здобувач вищої освіти відсутній на заняттях з поважної причини, він презентує виконані завдання під час самостійної підготовки та відповідно до графіку консультацій викладача. Політика щодо перескладання. Здобувачі вищої освіти повинні дотримуватися термінів виконання усіх завдань, передбачених програмою навчальної дисципліни. Ліквідація академічної заборгованості та перескладання екзамену проводиться після закінчення екзаменаційної сесії за окремим розкладом, складеним навчально-методичним відділом. Політика щодо оскарження результатів оцінювання. Якщо здобувач вищої освіти не згоден з оцінюванням рівня його знань він може оскаржити виставлену викладачем оцінку у встановленому порядку відповідно до Положення про організацію освітнього процесу у Національній академії статистики, обліку та аудиту, затвердженого рішенням Вченої ради НАСОА, протокол від 25 травня 2020 р. № 9.
--	--

КРИТЕРІЙ ТА МЕТОДИ ОЦІНЮВАННЯ

За результатами семестру здобувач вищої освіти отримує підсумкову оцінку за 100-бальною системою, яка розраховується як накопичена сума отриманих балів за всі види поточного, модульного та підсумкового контролю.

Умовою допуску до підсумкового контролю є набрання здобувачем вищої освіти 35 балів у сукупності за всіма темами дисципліни.

Якщо за результатами модульно-рейтингового контролю здобувач отримав сумарну кількість балів за два змістовні модулі, що не перевищує 34 бали, то здобувач вважається таким, що не виконав усі види робіт, які передбачаються навчальним планом з дисципліни «Прикладна статистика у фінансовій сфері» і направляється на повторний курс вивчення дисципліни.

Форми контролю	Види навчальної роботи	Оцінювання
<i>Денна форма навчання</i>		
ПОТОЧНИЙ КОНТРОЛЬ	Робота на лекціях	-
	Робота на семінарських / практичних заняттях	Максимум – 5 балів
	Виконання індивідуального кейс-завдання з фінансової статистики	Максимум – 5 балів
МОДУЛЬНИЙ КОНТРОЛЬ	Модульний контроль № 1	Максимум – 15 балів
	Модульний контроль № 2	Максимум – 15 балів
ПІДСУМКОВИЙ КОНТРОЛЬ	Екзамен	Максимум – 30 балів

Заочна форма навчання		
ПОТОЧНИЙ КОНТРОЛЬ	Робота на лекціях	-
	Робота на семінарських / практичних заняттях	-
	Модульний контроль № 1	Максимум – 35 балів
	Модульний контроль № 2	Максимум – 35 балів
ПІДСУМКОВИЙ КОНТРОЛЬ	Екзамен	Максимум – 30 балів

РОЗПОДІЛ БАЛІВ, ЯКІ ОТРИМУЮТЬ ЗДОБУВАЧІ

Поточний та модульний контроль										Екзамен	Сума
Змістовий модуль 1					Змістовий модуль 2				ТЗ		
Т1	Т2	Т3	Т4	МКР	Т5	Т6	Т7	МКР			30
5	5	5	5	15	5	5	5	15	5		

КРИТЕРІЇ ОЦІНЮВАННЯ РІВНЯ НАВЧАЛЬНИХ ДОСЯГНЕНЬ ЗДОБУВАЧІВ ВИЩОЇ ОСВІТИ

Критерії оцінювання поточного контролю

Поточний контроль проводиться викладачем на практичних заняттях протягом семестру шляхом перевірки завдань за кожною темою курсу та виконання індивідуального кейс-завдання з фінансової статистики (всього 40 балів за семестр).

Засобами оцінювання та методами демонстрування результатів навчання є:

- стандартизовані тести;
- завдання розрахункового характеру;
- презентації результатів виконаних завдань та досліджень;
- інші види індивідуальних та групових завдань.

Практичні заняття передбачають обговорення питань теми, розв'язання статистичних задач і кейсів, аналіз фінансових даних, ознайомлення з нормативно-правовою та методичною базою у сфері фінансів і статистики, а також проведення дискусій з ключових проблем прикладної статистики у фінансовій сфері. Робота на практичному занятті включає усне та письмове опитування, виконання розрахункових завдань і представлення результатів аналізу. Максимальна кількість балів, яку може отримати здобувач вищої освіти за одне практичне заняття, становить 5 балів.

Самостійна робота здобувачів вищої освіти полягає у вивченні теоретичних і прикладних аспектів курсу, опрацюванні статистичних даних, виконанні індивідуальних завдань та підготовці аналітичних матеріалів. Виконання самостійної роботи оцінюється під час практичних занять у формі усного чи письмового опитування, а також через представлення результатів індивідуальних статистичних досліджень.

Шкала оцінювання роботи здобувачів вищої освіти на практичних заняттях

Кількість балів	Критерії оцінювання
4-5	В повному обсязі володіє навчальним матеріалом з прикладної статистики у фінансовій сфері, вільно, самостійно та аргументовано викладає його під час усних виступів та письмових відповідей; глибоко та всебічно розкриває зміст теоретичних питань і практичних завдань; правильно застосовує статистичні методи для аналізу фінансових даних; правильно вирішив усі тестові та розрахункові завдання.

1-3	Не в повному обсязі володіє навчальним матеріалом; викладає його фрагментарно, поверхово, з недостатньою аргументацією під час усних виступів та письмових відповідей; неповно розкриває зміст теоретичних питань і практичних завдань; допускає суттєві неточності у застосуванні статистичних методів; правильно вирішив лише меншість тестових і розрахункових завдань.
0	Не володіє навчальним матеріалом з прикладної статистики; не здатен відтворити чи пояснити зміст теоретичних питань та практичних завдань; не розуміє сутності статистичних методів та їх застосування у фінансах; не вирішив жодного тестового чи розрахункового завдання.

Виконання індивідуального кейс-завдання спрямоване на закріплення теоретичних знань та набуття практичних навичок з дисципліни «Прикладна статистика у фінансовій сфері». Завдання виконується протягом опрацювання тем змістовного модуля 1.

Кейс-завдання з дисципліни виконується у формі статистичного аналізу реальних фінансових даних із застосуванням методів варіаційного, індексного, динамічного та кореляційно-регресійного аналізу. Результатом виконання є оформлений індивідуальний аналітичний звіт, який включає розрахунки, таблиці, графіки та висновки щодо виявлених тенденцій і закономірностей.

Орієнтовний перелік тем для індивідуального кейс-завдання (тема може коригуватися, за погодженням з викладачем):

1. Провести аналіз динаміки державного боргу України за останні 10 років за допомогою рядів динаміки.
2. Оцінити варіацію депозитного портфеля банківської системи України за допомогою показників дисперсії та коефіцієнта варіації.
3. Виконати індексний аналіз структури державних доходів (податкових і неподаткових) за останні 5 років.
4. Побудувати кореляційну модель між обсягами кредитування населення та рівнем реальних доходів домогосподарств.
5. Оцінити вплив інфляції на вартість страхових премій за допомогою індексів цін.
6. Дослідити динаміку прибутковості державних облігацій внутрішньої позики (ОВДП) і проаналізувати її тренд.
7. Побудувати регресійну модель залежності обсягів іпотечного кредитування від рівня середньої відсоткової ставки.
8. Виконати аналіз сезонності курсу національної валюти (гривня/долар США) за останні 5 років.
9. Здійснити індексний аналіз динаміки страхових виплат у сегменті автострахування.
10. Оцінити варіацію ринкової капіталізації провідних банків України на основі офіційної статистики.
11. Побудувати ряди динаміки обсягів іноземних інвестицій у фінансовий сектор України та оцінити середні темпи зростання.
12. Виконати регресійний аналіз впливу зміни облікової ставки НБУ на обсяги кредитування бізнесу.
13. Провести індексний аналіз змін вартості страхових послуг у сфері медичного страхування.
14. Проаналізувати залежність між рівнем безробіття та обсягом споживчих кредитів у банках.
15. Здійснити аналіз варіації структури доходів комерційних банків (процентні доходи, комісійні доходи тощо).

16. Побудувати прогнозні значення курсу гривні до євро на основі ряду динаміки та методу ковзних середніх.

17. Виконати аналіз структури страхового ринку України за видами страхування на основі індексів структурних зрушень.

18. Оцінити кореляційний зв'язок між обсягами зовнішньоторговельного обороту та міжнародними резервами України.

19. Дослідити вплив зміни середньої заробітної плати на рівень заощаджень населення за допомогою регресійної моделі.

20. Побудувати індекси цін на акції провідних компаній, що входять до UX-індексу, і проаналізувати тенденції.

21. Виконати статистичний аналіз структури видатків державного бюджету з урахуванням варіації за останні 7 років.

22. Проаналізувати залежність між рівнем інфляції та реальними доходами населення за допомогою кореляційного аналізу.

23. Побудувати динамічний ряд та оцінити середні темпи зростання страхових премій у сегменті страхування життя.

24. Виконати статистичний аналіз впливу курсу національної валюти на обсяги імпорту та експорту фінансових послуг.

25. Оцінити ефективність використання банківського капіталу за допомогою індексів продуктивності (ROA, ROE) у динаміці.

Кейс-завдання з дисципліни оцінюється в 5 балів.

Критерії оцінювання модульного контролю

Формою модульного контролю є модульні контрольні роботи, які проводяться у формі тестових завдань закритої форми, що формуються та виконуються в системі Moodle, та оцінюються від 0 до 15/35 балів.

Розподіл балів в межах модульних контрольних робіт

Вид завдання	Максимальна кількість балів за виконання (денна/заочна форма)
Тестові завдання закритої форми	15 (50×0,3) / 35 (50×0,7)
Всього	15 / 35

Критерії оцінювання підсумкового контролю

Формою підсумкового контролю є екзамен, який проводяться у формі тестових завдань закритої форми, що формуються та виконуються в системі Moodle, та оцінюється від 0 до 30 балів.

Розподіл балів в межах підсумкового контролю

Вид завдання	Максимальна кількість балів за виконання
Тестові завдання закритої форми	30 (70×0,43)
Всього	30

Критерії оцінювання тестових завдань закритої форми

Критерії оцінювання	Кількість балів
Здобувач дав правильні відповіді на 90-100% тестових запитань	27-30
Здобувач дав правильні відповіді на 82-89% тестових запитань	23-26
Здобувач дав правильні відповіді на 74-81% тестових запитань	20-22
Здобувач дав правильні відповіді на 64-73% тестових запитань	17-19
Здобувач дав правильні відповіді на 60-63% тестових запитань	15-16
Здобувач дав правильні відповіді менше ніж на 60% тестових запитань	0-14

Шкала оцінювання знань здобувачів вищої освіти

Оцінка за національною шкалою	Оцінка в балах	Оцінка за шкалою ECTS	
Екзамен		Оцінка	Пояснення
<i>Відмінно</i>	90-100	A	Здобувач вищої освіти демонструє високий рівень знань навчального матеріалу в обсязі, що відповідає програмі дисципліни, достатньо реалізовує теоретичні положення дисципліни в практичних розрахунках, виконав практичні завдання відмінно або з незначною кількістю помилок. За час навчання при проведенні практичних занять проявив вміння самостійно вирішувати поставлені завдання, активно включатись в дискусії, може відстоювати власну позицію в питаннях та рішеннях, що розглядаються
<i>Добре</i>	82-89	B	Здобувач вищої освіти демонструє гарні знання, добре володіє матеріалом, що відповідає програмі дисципліни, робить на їх основі аналіз можливих ситуацій та вміє застосовувати теоретичні положення при вирішенні практичних задач, але допускає окремі неточності. Вміє самостійно виправляти допущені помилки, кількість яких є незначною
	74-81	C	Здобувач вищої освіти в загальному добре володіє матеріалом, знає основні положення матеріалу, що відповідає програмі дисципліни, робить на їх основі аналіз можливих ситуацій та вміє застосовувати при вирішенні типових практичних завдань, але допускає окремі неточності. Помилки у відповідях та розрахунках не є системними. Знає характеристики основних положень, що мають визначальне значення при проведенні практичних занять та поясненні прийнятих рішень, в межах дисципліни, що вивчається.
<i>Задовільно</i>	64-73	D	Здобувач вищої освіти засвоїв основний теоретичний матеріал, передбачений програмою дисципліни. При вирішенні практичних завдань допускає значну кількість недоліків і суттєвих помилок
	60-63	E	Здобувач вищої освіти має певні знання, передбачені в програмі дисципліни, володіє основними положеннями, що вивчаються на рівні, який визначається як мінімально допустимий. З використанням основних теоретичних положень, здобувач вищої освіти з труднощами пояснює правила вирішення практичних завдань дисципліни, відсутнє розуміння порядку виконання завдання та взаємозв'язків з іншими дисциплінами.
<i>Незадовільно</i>	35-59	FX	Здобувач вищої освіти може відтворити окремі фрагменти з курсу. Незважаючи на те, що програму дисципліни здобувач вищої освіти виконав, працював він пасивно, його відповіді під час практичних робіт в більшості є неправильними, необґрунтованими. Цілісність розуміння матеріалу з дисципліни у

			здобувача вищої освіти відсутні. Здобувач вищої освіти має можливість повторного складання.
	1-34	F	Здобувач вищої освіти повністю не виконав вимоги програми навчальної дисципліни. Його знання на підсумкових етапах навчання є фрагментарними. Обов'язкове повторне вивчення дисципліни.

ПИТАННЯ ДЛЯ ПІДСУМКОВОГО КОНТРОЛЮ ЗНАНЬ

1. Предмет і об'єкт прикладної статистики у фінансовій сфері.
2. Завдання фінансової статистики у умовах цифрової економіки.
3. Методи прикладної статистики та їх застосування у фінансах.
4. Взаємозв'язок прикладної статистики з іншими економічними науками.
5. Роль фінансової статистики у прийнятті управлінських рішень.
6. Класифікація фінансово-статистичних показників.
7. Поняття статистичного спостереження у фінансовій сфері.
8. Види статистичних спостережень у фінансах.
9. Джерела статистичної інформації у фінансовому секторі.
10. Вимоги до якості фінансово-статистичної інформації.
11. Етапи статистичного дослідження фінансових процесів.
12. Інформаційна база офіційної фінансової статистики України.
13. Міжнародні джерела фінансової статистики.
14. Використання великих даних (Big Data) у фінансовій статистиці.
15. Абсолютні величини у фінансовій статистиці.
16. Відносні величини у фінансових дослідженнях.
17. Середні величини та їх роль у фінансовому аналізі.
18. Метод індексів у фінансовій статистиці.
19. Індеси цін та їх застосування у фінансових ринках.
20. Індеси кількісних показників у банківській та страховій діяльності.
21. Побудова зведених індексів у фінансовій статистиці.
22. Аналіз індексів вартості страхових премій.
23. Індеси рентабельності фінансових установ.
24. Методологія міжнародних фінансових індексів.
25. Практичне значення індексного аналізу у фінансовій сфері.
26. Поняття ряду динаміки у фінансовій статистиці.
27. Основні характеристики рядів динаміки.
28. Середні величини ряду динаміки.
29. Абсолютний приріст, темпи зростання і темпи приросту.
30. Середній темп зростання у фінансових показниках.
31. Поняття варіації та її значення у фінансовій статистиці.
32. Дисперсія та середнє квадратичне відхилення у фінансових даних.
33. Коефіцієнт варіації як показник ризику.
34. Графічні методи аналізу фінансових рядів динаміки.
35. Трендові моделі у фінансовій статистиці.
36. Аналіз сезонності у фінансових процесах.
37. Методи згладжування рядів динаміки.
38. Прогнозування фінансових показників на основі часових рядів.
39. Використання статистичних пакетів для аналізу динаміки.
40. Поняття кореляції у фінансовій статистиці.
41. Види кореляційних зв'язків.
42. Коефіцієнт кореляції та його інтерпретація.
43. Регресійний аналіз у фінансових дослідженнях.
44. Парна лінійна регресія у фінансових задачах.

45. Множинна регресія у фінансових моделях.
46. Перевірка значущості кореляційних зв'язків.
47. Визначення тісноти зв'язку між фінансовими показниками.
48. Застосування кореляційного аналізу у банківській статистиці.
49. Регресійні моделі в аналізі страхового ринку.
50. Практичне використання кореляційно-регресійного аналізу в прогнозуванні фінансових рішень.
51. Показники ресурсної бази банків.
52. Аналіз структури активів і пасивів банків.
53. Динаміка обсягів кредитування та депозитів.
54. Статистичні методи оцінки ліквідності банків.
55. Індeksi процентних ставок за кредитами та депозитами.
56. Вплив монетарної політики на банківську статистику.
57. Статистичні методи оцінки платоспроможності банків.
58. Використання кореляційно-регресійного аналізу у прогнозуванні кредитної активності.
59. Аналіз варіації прибутковості банків.
60. Практичні кейси статистичного аналізу у банківській діяльності.
61. Статистичні показники страхових премій.
62. Показники страхових виплат.
63. Індeksi зміни страхових тарифів.
64. Статистичні методи оцінки фінансової стійкості страхових компаній.
65. Аналіз варіації страхових резервів.
66. Показники прибутковості страхових операцій.
67. Використання рядів динаміки у дослідженні страхових виплат.
68. Кореляція між преміями і виплатами у страховій діяльності.
69. Міжнародні стандарти статистики страхового ринку.
70. Практичні приклади застосування статистики у страхуванні.
71. Статистичні методи оцінки інвестиційних ризиків.
72. Поняття Value at Risk (VaR) у статистиці ризиків.
73. Методи Монте-Карло в оцінюванні фінансових ризиків.
74. Використання часових рядів у прогнозуванні фінансових ринків.
75. Трендові моделі у прогнозуванні фондового ринку.
76. Сезонні моделі у прогнозуванні фінансових процесів.
77. Регресійні моделі у прогнозуванні інвестиційних показників.
78. Використання ковзних середніх у прогнозуванні курсів валют.
79. Методи експоненціального згладжування у фінансовій статистиці.
80. Побудова сценаріїв розвитку фінансових ринків.
81. Порівняння статистичних методів аналізу фінансових рядів динаміки.
82. Використання індексів для аналізу фінансових ризиків.
83. Застосування кореляційного аналізу у фінансовому менеджменті.
84. Інтерпретація статистичних даних у банківській і страховій діяльності.
85. Проблеми збору фінансової статистики в умовах воєнного стану.
86. Сучасні програмні засоби для фінансово-статистичного аналізу.
87. Використання відкритих даних у фінансовій статистиці.
88. Роль прикладної статистики у стратегічному фінансовому управлінні.
89. Порівняння методів прогнозування у фінансовій статистиці.
90. Прикладні аспекти аналізу варіації у фінансовій сфері.
91. Застосування регресійних моделей для оцінки фінансової стійкості.
92. Практичні труднощі у використанні статистичних методів у фінансах.
93. Актуальність Big Data та машинного навчання у фінансовій статистиці.
94. Порівняльний аналіз української та міжнародної фінансової статистики.

95. Прикладна статистика як інструмент антикризового управління.
96. Етичні аспекти використання статистики у фінансовій сфері.
97. Використання прикладної статистики у державному фінансовому контролі.
98. Роль статистичних прогнозів у формуванні фінансової політики.
99. Застосування прикладної статистики у цифровому банкінгу та фінтех.
100. Значення прикладної статистики у професійній діяльності фінансиста.

РЕКОМЕНДОВАНА ЛІТЕРАТУРА:

Основна:

1. Про Національний банк України : Закон України від 20 трав. 1999 р. № 679-XIV (зі змінами). URL: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/679-14#Text>
2. Про страхування : Закон України від 18 лист. 2021 р. № 1909-IX (зі змінами). URL: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/main/1909-IX?msclid=76cc49d6b5ac11ec81de9b33d00654e1#top>
3. Войцеховська Ю.В., Новаківський І.І. Основи статистичного прогнозування економічних процесів : навч. посіб. Львів : Новий Світ -2000, 2025. 200 с.
4. Герасименко С. С., Голубова Г. В., Потапова М. Ю., Червона С. П. Статистика : навч. посіб. / За ред. О. Г. Осауленка. Київ : НАСОА, 2022. 265 с.
5. Мельник Т. А., Сибірцев В. В. Страхування: навч. посіб. Кропивницький: ПП «Ексклюзив Систем», 2022. 307с.
6. Маханець Л. Л., Вінничук О. Ю., Григорків М. В. Статистика: лабораторний практикум у STATISTICA 12 : навч. посіб. Чернівці : Чернівець. нац. ун-т ім. Ю. Федьковича, 2023. 161 с. URL : <https://archer.chnu.edu.ua/xmlui/handle/123456789/6548>
7. Чубака О., Скоропад І., Курило А. Фінансова статистика : підруч. Київ : Кондор, 2023. 212 с.
8. Якимова Л. П. Оптимізаційні методи та моделі : практикум в MS Excel : навч.-метод. посіб. Чернівці : Чернівець. нац. ун-т ім. Ю. Федьковича, 2022. 272 с. URL : https://archer.chnu.edu.ua/xmlui/bitstream/handle/123456789/4668/Larysa%20Yakymova_Optimization%20methods%20and%20models%20%20workshop%20in%20MS%20Excel.pdf?sequence=1&isAllowed=y

Додаткова:

1. Герасименко С.С., Голубова Г.В. Методи бізнес-статистики як фундаментальні інструменти управління бізнес-процесами. *Сучасна статистика*: матеріали XX Міжнар. наук.-практ. конф. з нагоди Дня працівників статистики. Київ: «Інформаційно-аналітичне агентство», 2022. С. 93-95. URI: <https://ir.nasoa.edu.ua/items/250cdf83-627e-4ea8-8498-5ba4a839656d>
2. Голубова Г. В. Особливості моделювання експортно-імпортних операцій на часових рядах. *Бізнес-аналітика в управлінні зовнішньоекономічною діяльністю*: матеріали VIII Міжнар. наук.-практ. конф. (м. Київ, 17 березня 2021 р.). Київ: ДП «Інформаційно-аналітичне агентство», 2021. С. 71-73. URI: <https://ir.nasoa.edu.ua/items/24fe5d39-81dc-4d61-9c38-c6049820d977>
3. Голубова Г. В. Фіскальні ризики для України в умовах війни. *Стратегія розвитку України: фінансово-економічний та гуманітарний аспекти*: матеріали IX Міжнар. наук.-практ. конф. Київ, «Інформаційно-аналітичне агентство», 2022. С. 69-74. URL: <https://ir.nasoa.edu.ua/items/cec8c265-fc8d-4728-86a0-be3efb1f0ffa>
4. Голубова Г. В., Харабара Т. І. Статистика судових оскаржень рішень міжвідомчої комісії з міжнародної торгівлі у боротьбі з демпінговим імпортом. *Бізнес-аналітика в управлінні зовнішньоекономічною діяльністю*: матеріали Міжнар. наук.-практ. конф. Київ: ТОВ «НВП «Інтерсервіс», 2023. С. 155-159. URL: <https://ir.nasoa.edu.ua/items/d5234ace-7119-4a1b-8747-84bfd87f09bc>

5. Голубова Г.В., Самойленко А. Моделювання та прогнозування прямих іноземних інвестицій на основі кореляційно-регресійного аналізу. *Бізнес-аналітика в управлінні зовнішньоекономічною діяльністю*: матеріали IX Міжнар. наук.-практ. конф. (м. Київ, 17 березня 2022 р.). Київ: Інтерсервіс, 2022. С. 141-146. URL: <https://ir.nasoa.edu.ua/items/8bdbc406-5c80-4ab6-ba86-c943217746cd>
6. Парфенцева Н. О., Голубова Г. В. Моделювання фінансових ризиків на основі статистичних методів оцінювання. *Науковий вісник Національної академії статистики, обліку та аудиту*. 2022. №1-2. С. 14-20. URL: <https://nasoa-journal.com.ua/index.php/journal/article/view/257>
7. Парфенцева Н.О., Голубова Г.В., Самойленко А.І. Статистичне оцінювання та моделювання інвестиційної привабливості регіонів України. *Європейський науковий журнал економічних та фінансових інновацій*. 2021. №8 (2). С. 66-78. URL: <https://www.journal.eae.com.ua/index.php/journal/article/view/146/127>
8. Фінансові інструменти сталого економічного розвитку: антропоцентричні виміри: монографія / за заг. ред. П. О. Нікіфорова. Чернівці : Чернівець. нац. ун-т ім. Ю. Федьковича, 2025. 744 с. URL : <https://archer.chnu.edu.ua/xmlui/handle/123456789/12613>
9. Ahlawat S. Statistical Quantitative Methods in Finance: From Theory to Quantitative Portfolio Management. Berkeley, CA : Apress, 2025. 301 p.
10. Gerasymenko S. Holubova H. Statistical Assessment of Risks of Banking Activity. *Scientific Bulletin of the National Academy of Statistics, Accounting and Audit*. 2022. №3-4. Pp. 5-14. URL: <https://nasoa-journal.com.ua/index.php/journal/article/view/266>
11. Holubova H. A comparative analysis of the principal component method and parallel analysis in working with official statistical data. *Statistics in Transition new series*. 2023. Vol. 24(1). Pp. 199-212. URL: <https://sit.stat.gov.pl/Article/778>
12. Holubova H. V. Financial Stress Index as an Indicator of Financial Stability of Ukraine in War Conditions. *Statistics of Ukraine*. 2022. №97(2). Pp. 4-11. URL: <https://su-journal.com.ua/index.php/journal/article/view/371>
13. Mavruk T. Quantitative Research Methods in Corporate Finance: Exemplified by Stata, Python, and R. Cambridge : Cambridge University Press, 2025. 318 p.
14. Parfentseva N. O., Holubova H. V. Statistical Methods for Quality Control: A Tool for Data Analysis in the Statistica Package. *Statistics of Ukraine*. 2023. №100(1). С. 9-26. URL: [https://doi.org/10.31767/su.1\(100\)2023.01.02](https://doi.org/10.31767/su.1(100)2023.01.02)

Інформаційні ресурси в Інтернеті:

1. Офіційний сайт Державної служби статистики України. URL: <https://www.ukrstat.gov.ua/>
2. Офіційний сайт Євростату. URL: <https://ec.europa.eu/eurostat>
3. Офіційний сайт Міністерства економіки, довкілля та сільського господарства України. URL: <https://me.gov.ua/?lang=uk-UA>
4. Офіційний сайт Міністерства фінансів України. URL: <https://www.mof.gov.ua>
5. Офіційний сайт Національного банку України. URL: <http://www.bank.gov.ua>
6. Офіційний сайт Національної комісії з цінних паперів та фондового ринку. URL: <https://www.nssmc.gov.ua/>

Розглянуто та затверджено на засіданні кафедри статистики та математичних методів в економіці, протокол №1 від 27 серпня 2025р.