

**МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ОДЕСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ ЕКОНОМІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ**

Кредитно-економічний факультет

Кафедра банківської справи

Допустити до захисту

Завідувач кафедри _____
(підпис)

д.е.н., професор Кузнєцова Л.В.

“ ____ ” _____ 2015 року

Дипломна робота

на здобуття

освітньо-кваліфікаційного рівня магістра

з теми: **«Управління валютним ризиком банку»**

Виконала: студентка 5 курсу, групи 3
спеціальності 8.03050802
«Банківська справа»

Дяченко Катерина Данилівна

Керівник: д.е.н., професор
Кузнєцова Людмила Вікторівна

Рецензент: Виноградова Людмила
Вікторівна

ОДЕСА - 2015 року

АНОТАЦІЯ

Предметом дослідження є валютний курс, валютний ризик, чинники, що впливають на зміну валютного курсу.

Об'єктом дослідження є банківська система України та АТ «Укресімбанк»

Мета дипломної роботи полягає в визначити чинники, що впливають на зміну валютного курсу, проаналізувати, як зміна курсу вплинула на діяльність конкретного банку, розробка регресійної моделі валютного курсу.

Завданнями роботи є проаналізувати сучасні методи управління валютними ризиками; виокремити рівні валютного регулювання та проаналізувати еволюційні зміни валютної політики України; проаналізувати динаміку макроекономічних показників, які впливають на валютний курс; дослідити міру впливу валютного ризику у АТ «Укресімбанк»; розробити регресійну модель.

За результатами дослідження сформульовані рекомендації щодо методів управління валютним ризиком., розроблена економетрична модель валютного курсу.

Одержані результати можуть бути використані для врегулювання кризи на валютному ринку, мінімізації втрат банку через валютний ризик.

Рік виконання дипломної роботи 2015

Рік захисту роботи 2015

Ключові слова валютний ризик, валютний курс, чинники валютного курсу, управління ризиком.

Дипломна робота містить 103 сторінки, 15 таблиць, 10 рисунків, список літератури з 60 найменувань, 4 додатків.

ЗМІСТ

ВСТУП.....	4
РОЗДІЛ 1. ТЕОРЕТИЧНІ ОСНОВИ УПРАВЛІННЯ ВАЛЮТНИМ РИЗИКОМ БАНКУ.....	7
1.1 Сутність та види валютного ризику банку	7
1.2. Рівні сучасного ризик-менеджменту в сфері управління валютним ризиком банку.....	20
Висновок до першого розділу.....	29
РОЗДІЛ 2. АНАЛІЗ РОЗВИТКУ ВАЛЮТНИХ ОПЕРАЦІЙ БАНКІВ В УКРАЇНІ.....	32
2.1.Етапи розвитку банківського валютного регулювання в Україні.....	32
2.2 Структуризація та аналіз чинників, що зумовлюють валютний ризик.....	39
2.3 Аналіз сучасного стану здійснення валютних операцій АТ «Укрексімбанк».....	51
Висновки до другого розділу.....	60
РОЗДІЛ 3.НАУКОВО-МЕТОДИЧНІ ПІДХОДИ ДО УДОСКОНАЛЕННЯ МЕТОДІВ УПРАВЛІННЯ ВАЛЮТНИМИ РИЗИКАМИ.....	63
3.1 Методи оцінки валютного ризику.....	63
3.2 Моделювання та прогнозування чинників валютного курсу, як метод управління валютним ризиком.....	69
Висновки до третього розділу.....	78
ВИСНОВКИ.....	80
СПИСОК ВИКОРИСТАНИХ ДЖЕРЕЛ.....	86
ДОДАТКИ.....	93