

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ОДЕСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ ЕКОНОМІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
Кафедра фінансового менеджменту та фондового ринку

Допущено до захисту
завідувач кафедри ФМФР
_____ (Гончаренко О.М.)
“ _____ ” _____ 20 р.

ДИПЛОМНА РОБОТА
на здобуття освітньо-кваліфікаційного
рівня магістра

зі спеціальності 8.03050801 “Фінанси кредит ” за програмою:
«Фінасовий менеджмент»

за темою:
Управління ліквідністю комерційного банку (на прикладі
ПАТ«Укресімбанк»)

Виконавець:

Студент

Фінансово-економічного факультету

(факультет)

Айко Ігор Володимирович

(прізвище, ім'я та по - батькові) /підпис/

Науковий керівник:

Старший викладач

(вчений ступінь, вчене звання)

Захаренко Олена Олександрівна

(прізвище, ім'я та по - батькові) /підпис/

Одеса 2015

ЗМІСТ

ВСТУП.....	3
РОЗДІЛ 1. ТЕОРЕТИЧНІ ОСНОВИ УПРАВЛІННЯ ЛІКВІДНІСТЮ КОМЕРЦІЙНОГО БАНКУ.....	6
1.1. Сутність та значення управління ліквідністю банку.....	6
1.2 Сучасні теорії та методи оцінки ліквідності.....	13
1.3 Теорії та методи управління ліквідністю.....	20
РОЗДІЛ 2. ПОРЯДОК ОЦІНКИ ЛІКВІДНОСТІ КОМЕРЦІЙНОГО БАНКУ З ВИКОРИСТАННЯМ СУЧАСНИХ МЕТОДИК НА ПРИКЛАДІ ПАТ «Укрексімбанк»	36
2.1 Загальна характеристика та історія діяльності «Укрексімбанк»	36
2.2 Комплексний аналіз ліквідності ПАТ «Укрексімбанк»	44
2.3. Аналіз фінансового стану ПАТ «Укрексімбанк».....	53
РОЗДІЛ 3. ШЛЯХИ ПОКРАЩЕННЯ ПОКАЗНИКІВ ЛІКВІДНОСТІ ПАТ «Укрексімбанк»	68
3.1. Основні проблеми та перешкоди на шляху покращення показників ліквідності комерційного банку.....	73
3.2. Заходи та рекомендації щодо підвищення ефективності управління ліквідністю	85
ВИСНОВКИ.....	93
СПИСОК ВИКОРИСТАНОЇ ЛІТЕРАТУРИ	99
ДОДАТКИ.....	104