

УНІВЕРСИТЕТ ІМЕНІ АЛЬФРЕДА НОБЕЛЯ
КАФЕДРА ГЛОБАЛЬНОЇ ЕКОНОМІКИ

КВАЛІФІКАЦІЙНА РОБОТА МАГІСТРА

на тему

Валютні ризики на світовому ринку

Виконав: здобувач II курсу, групи МЕВ-20вм
ОПП з міжнародних економічних відносин
Спеціальності 292 Міжнародні економічні відносини

Борисенко С. А.

Керівник: Кузьмінов С.В., д.е.н., професор

Дніпро
2023

АНОТАЦІЯ

Борисенко Сергій Анатолійович. Валютні ризики на світовому ринку.

У роботі розглянуто теоретичні та практичні аспекти поняття валютного ризику, вивчене питання управління валютними ризиками та побудови інформаційної системи банку на основі сучасних методів оцінки валютних ризиків. Проаналізована система управління валютними ризиками на прикладі Першого українського міжнародного банку. Досліджені проблеми та перспективи оптимізації валютних ризиків за раїунок хеджування у світі та в Україні.

Ключові слова: валютний ризик, оцінка валютних ризиків, інформаційні технології, управління ризиками.

ABSTRACT

Borysenko Serhii. Currency risks at the world market.

The paper examines the theoretical and practical aspects of the concept of currency risk, considers the issue of currency risk management and the construction of the bank's information system based on modern methods of currency risk assessment. The currency risk management system was analyzed using the example of the First Ukrainian International Bank. The problems and prospects of currency risk optimization for the purpose of hedging in the world and in Ukraine are studied.

Key words: currency risk, currency risk assessment, information technology, risk management.

ЗМІСТ

ВСТУП	3
РОЗДІЛ 1. ПОНЯТТЯ ВАЛЮТНИХ РИЗИКІВ І МЕТОДИ ЇХ СТРАХУВАННЯ	6
1.1. Поняття і головні чинники виникнення валютних ризиків	6
1.2. Особливості управління валютними ризиками	12
1.3. Страхування від валютних ризиків	17
РОЗДІЛ 2. ДОСЛІДЖЕННЯ ТА АНАЛІЗ СИСТЕМИ СТРАХУВАННЯ ВАЛЮТНИХ РИЗИКІВ НА ПРИКЛАДІ ПЕРШОГО УКРАЇНСЬКОГО МІЖНАРОДНОГО БАНКУ	17
2.1. Діяльність Першого Українського Міжнародного банку	26
2.2. Управління ризиками в ПУМБ	31
2.3. Система оцінки ризиків	
2.4. Система страхування валютних ризиків в ПУМБ	34
РОЗДІЛ 3. РОЗРОБКА СУЧАСНИХ МЕТОДІВ СТРАХУВАННЯ ВАЛЮТНИХ РИЗИКІВ	34
3.1. Хеджування валютних ризиків. Форвардні контракти як інструмент хеджування валютних ризиків	56
	64
3.2. Хеджування валютними ф'ючерсами	64
3.3. Хеджування валютних ризиків за допомогою своп-контрактів	75
ВИСНОВКИ ТА ПРОПОЗИЦІЇ	
СПИСОК ВИКОРИСТАНИХ ДЖЕРЕЛ	86
	95