

**УНІВЕРСИТЕТ БАНКІВСЬКОЇ СПРАВИ  
НАЦІОНАЛЬНОГО БАНКУ УКРАЇНИ (м. Київ)**

**ШАТКОВСЬКА-ШМОРГАЙ Вікторія Борисівна**

УДК 336.71.078.3:336.743:330.131.7

**ФОРМУВАННЯ БАНКАМИ СИСТЕМИ МОНІТОРИНГУ  
В ПРОЦЕСІ УПРАВЛІННЯ ВАЛЮТНИМ РИЗИКОМ**

Спеціальність: 08.00.08 – Гроші, фінанси і кредит

**АВТОРЕФЕРАТ**  
**дисертації на здобуття наукового ступеня**  
**кандидата економічних наук**

Київ  
2010

Дисертацією є рукопис.

Робота виконана в Університеті банківської справи Національного банку України (м. Київ).

**Науковий керівник:** кандидат економічних наук, доцент  
*Лапішко Марія Львівна*,  
Львівський інститут банківської справи  
Університету банківської справи  
Національного банку України,  
декан факультету банківської справи  
та інформаційних технологій.

**Офіційні опоненти:** доктор економічних наук, професор,  
*Мороз Анатолій Миколайович*,  
Київський національний економічний  
університет імені Вадима Гетьмана,  
завідувач кафедри банківської справи;

кандидат економічних наук,  
*Береславська Олена Іванівна*,  
Науково-дослідний центр з питань оподаткування  
Національного університету  
державної податкової служби України,  
провідний науковий співробітник.

Захист відбудеться 15 червня 2010 року о годині на засіданні Спеціалізованої вченої ради К 26.883.01 із захисту дисертацій на здобуття наукового ступеня кандидата наук в Університеті банківської справи Національного банку України за адресою: 04070, м. Київ, вул. Андріївська, 1, ауд. 207.

З дисертацією можна ознайомитись у бібліотеці Університету банківської справи Національного банку України за адресою: 04119, м. Київ, вул. Білоруська, 17.

Автореферат розісланий 11 травня 2010 року.

Вчений секретар  
Спеціалізованої вченої ради,  
доктор економічних наук, професор



О. О. Лапко

**Формування банками системи моніторингу в процесі управління валютним ризиком:**

автореф. дис. ... канд. екон. наук : 08.00.08 / В. Б. Шатковська-Шморгай; Ун-т банк. справи Нац. банку України. — К., 2010. — 20 с. — укр.

Розкрито сутність валютного ризику. Уточнено та систематизовано підходи щодо класифікації чинників валютного курсу як основного чинника валютного ризику. Визначено особливості наукових підходів щодо формування банками системи моніторингу в процесі управління валютним ризиком. Проаналізовано сутність понять "моніторинг" і "система моніторингу", інструментарій оцінювання валютного ризику вітчизняними банками.

Розроблено рекомендації щодо проведення стрес-тестування валютного ризику та складання форм звітності. Запропоновано рекомендації щодо вдосконалення процесу управління валютним ризиком банків на базі даних методологічних підходів щодо формування банками власних систем моніторингу.

*Індекс рубрикатора НБУВ: У9(4УКР)262.6-18*

*Шифр зберігання книги/журналу в НБУВ: **РА373440***