

**НАЦІОНАЛЬНА АКАДЕМІЯ НАУК
ІНСТИТУТ РЕГІОНАЛЬНИХ ДОСЛІДЖЕНЬ**

РУДЕНКО МАКСИМ ОЛЕКСАНДРОВИЧ

УДК 336.717

**УПРАВЛІННЯ ДІЯЛЬНІСТЮ БАНКІВ
У СФЕРІ ФІНАНСОВИХ ІНВЕСТИЦІЙ**

Спеціальність 08.00.08 – гроші, фінанси і кредит

АВТОРЕФЕРАТ

дисертації на здобуття наукового ступеня
кандидата економічних наук

Львів – 2013

Дисертацією є рукопис.

Роботу виконано в Львівському інституті банківської справи Університету банківської справи Національного банку України (м. Київ)

Науковий керівник: кандидат економічних наук, доцент
Пшик Богдан Іванович,
Львівський інститут банківської справи
Національного банку України (м. Київ),
доцент кафедри банківської справи

Офіційні опоненти: доктор економічних наук, професор
Луців Богдан Любомирович,
Тернопільський національний економічний університет,
МОНмолодьспорту України,
професор кафедри банківського менеджменту і обліку,
проректор з науково-педагогічної роботи
(міжнародні зв'язки)

кандидат економічних наук, доцент
Кльоба Лев Гнатович,
Національний університет "Львівська політехніка"
МОНмолодьспорту України,
доцент кафедри фінансів

Захист відбудеться 24 вересня 2012 р. о 12.00 годині на засіданні спеціалізованої вченої ради К 35.154.02 в Інституті регіональних досліджень НАН України за адресою: 79026, м. Львів, вул. Козелецька, 4.

З дисертацією можна ознайомитись у бібліотеці Інституту регіональних досліджень НАН України за адресою: 79026, м. Львів, вул. Козелецька, 4.

Автореферат розісланий 23 серпня 2012р.

Вчений секретар
спеціалізованої вченої ради,
доктор економічних наук

І.З. Сторонянська

Руденко М.О. Управління діяльністю банків у сфері фінансових інвестицій.– Рукопис.

Дисертація на здобуття наукового ступеня кандидата економічних наук за спеціальністю 08.00.08 – гроші, фінанси і кредит/ Інститут регіональних досліджень НАН України. –Львів, 2012.

У дисертаційній роботі проведено комплексне дослідження діяльності комерційних банків у сфері фінансового інвестування, що полягало в теоретичному узагальненні механізмів цієї діяльності та вирішенні науково-практичного завдання підвищення ефективності фінансових інвестицій комерційних банків. Проведено аналіз наявних теоретичних концепцій "інвестицій" загалом і "банківських фінансових інвестицій" зокрема, на основі чого сформовано власну класифікацію банківських фінансових інвестицій.

Проведено аналіз моделей організації інвестиційної діяльності банків на ринку цінних паперів, розкрито особливості функціонування універсальних і спеціалізованих банків, досліджено їхні переваги і недоліки. Виявлено основні важелі забезпечення ефективності банків у сфері фінансових інвестицій, насамперед у площині вибору між дохідністю і ризиком. На основі емпіричного дослідження продемонстровано можливості застосування на українському фондовому ринку класичних підходів із використанням математичного та модельного інструментарію для підвищення ефективності портфельних інвестицій. Досліджено діяльність українських комерційних банків на ринку цінних паперів, розкрито особливості структури і динаміки операцій банків з окремим фінансовими інструментами. Запропоновано низку заходів, спрямованих на підвищення ефективності діяльності комерційних банків у сфері фінансових інвестицій як з боку керівництва комерційних банків, так і з боку органів державного регулювання.

Ключові слова: комерційні банки, фінансові інвестиції, ринок цінних паперів, портфельні інвестиції, портфельна теорія, оптимізація інвестиційного портфеля, управління.