

АНОТАЦІЯ

Кириченко Я.В. «Управління цінними паперами в портфельному інвестуванні (на прикладі АТ КБ Приватбанк)». – Рукопис.

Кваліфікаційна робота на здобуття освітньо-кваліфікаційного рівня магістра за спеціальністю 072 «Фінанси, банківська справа та страхування» – НТУ «Дніпровська політехніка», Дніпро, 2019.

В першому розділі досліджено теоретичні основи оптимізації портфелю цінних паперів, управління банківським портфелем цінних паперів в умовах нестабільності на фондовому ринку.

В другому розділі здійснено аналіз існуючих методик оптимізації портфелю цінних паперів, а також проведено аналіз діяльності АТ КБ Приватбанк.

В третьому розділі здійснено оптимізацію портфелю цінних паперів за допомогою різних моделей.

В четвертому розділі проведена оцінка економічної ефективності оптимізації банківського портфелю цінних паперів.

ОПТИМІЗАЦІЯ, ПОРТФЕЛЬ ЦІННИХ ПАПЕРІВ, ДОХОДНІСТЬ, РИЗИК

ANNOTATION

Kirichenko Y.V. « Securities management in the portfolio investments (in terms of “ Privatbank” JSC CB)».-Manuscript.

Thesis for obtaining the educational qualification of Masters degree in 072 – Finances, Banking and Insurance – Dnipro University of Technology, Dnipro, 2019.

The first section explores the theoretical fundamentals of securities portfolio optimization, managing the bank's securities portfolio in conditions of stock market volatility.

In the second section, the analysis of existing methods of optimization of the securities portfolio is carried out, as well as the analysis of the bank's activity is carried out.

The third section optimizes the securities portfolio using different models.

The fourth section assesses the cost-effectiveness of optimizing the bank's securities portfolio.

OPTIMIZATION, SECURITY PORTFOLIO, PROFITABILITY, RISK