

**Назва.** Фінансовий інжиніринг у банку.

**Тип.** Базова.

**Рік навчання.** 2022–2023.

**Семестр.** 1.

**Кількість кредитів ЄКТС.** 4.

**ПІБ лектора, науковий ступінь, посада.** Азізова К.М., к. екон. н., доц.

### **Результати навчання.**

Здатність до застосування методів економічного аналізу та моделювання фінансових ринків;

здатність до аналізу звітності організацій та до проведення діагностики їх фінансового стану;

здатність до управління портфелем цінних паперів;

здатність до оцінювання вартості фінансових активів;

здатність до виявлення та управління ризиками в діяльності клієнтів і володіння відповідними інструментами зниження цих ризиків;

здатність управляти системами фінансової інформації;

здатність працювати з похідними фінансовими інструментами у банку.

### **Обов'язкові попередні навчальні дисципліни.**

«Банківська справа», «Гроші і кредит», «Фінанси», «Основи фінансової грамотності».

### **Зміст.**

Сутність фінансового інжинірингу та причини його виникнення. Інструменти фінансового інжинірингу у банку. Форвард – контрактний фінансовий інструмент. Ф'ючерсний контракт – фінансовий інструмент біржової торгівлі. Опціони – фінансовий інструмент біржового та позабіржового ринків. Ризики укладання операцій своп. Фінансові інструменти власного капіталу. Електронний трейдинг та програмна торгівля. Технології фінансового інжинірингу у банку. Стратегії фінансового інжинірингу у банку.

### **Рекомендовані джерела.**

1. Болдуєва О. В. Організаційно-економічний механізм регулювання ринку цінних паперів в Україні : монографія / О. В. Болдуєва. – Запоріжжя : Запорізь. нац. ун-т, 2011. – 262 с.

2. Болдуєва О. В. Інституційні аспекти розвитку ринку цінних паперів в Україні : монографія / О. В. Болдуєва. – Запоріжжя : Класич. приват. ун-т, 2013. – 391 с.

3. Герасименко О. М. Індикатори оцінки стану системи економічної безпеки торговців цінними паперами : монографія / О. М. Герасименко. – Черкаси : [б. в.], 2012. – 236 с.

4. Давидов О. І. Депозитарна інфраструктура ринку цінних паперів України : монографія / О. І. Давидов, Т. В. Лапшина. – Х. : ХНУ ім. В. Н. Каразіна,

2011. – 261 с.

5. Крючков В. О. Шляхи поліпшення кредитних, інвестиційних операцій банків та їхньої роботи з цінними паперами : монографія / В. О. Крючков. – К. : Фенікс, 2010. – 168 с.

6. Лісовий В. П. Торгівля цінними паперами : навч. посіб. / В. П. Лісовий, К. Г. Отченаш, В. В. Токар. – К. : КНЕУ, 2012. – 369 с.

7. Лук'яненко І. Г. Оцінювання інвестицій та цінних паперів у фінансовому менеджменті : навч. посіб. / І. Г. Лук'яненко. – К. : [б. в.], 2012. – 227 с.

8. Маршал Дж. Ф. Финансовая инженерия: Полное руководство по финансовым нововведениям / Дж. Ф. Маршал, В. К. Бансал ; пер. с англ. – М. : ИНФРА-М, 1998. – 784 с.

9. Павлов В. І. Формування інституційної системи ринку цінних паперів в Україні : монографія / В. І. Павлов, Н. М. Кіндрацька. – Рівне : НУВГП, 2011. – 294 с.

10. Пантелєєв В. П. Фінансові операції з цінними паперами: здійснення та облік: монографія / В. П. Пантелєєв. – Х. : ХНУ ім. В. Н. Каразіна, 2010. – 334 с.

11. Професійна діяльність на ринку цінних паперів: депозитарна діяльність : навч.-метод. посіб. / [упоряд. : Бовкун К. К. та ін.]. – К. : АДС УМК Центр, 2011. – 486 с.

12. Професійна діяльність на ринку цінних паперів: торгівля цінними паперами : навч.-метод. посіб. / [упоряд.: Бовкун К. К. та ін.]. – К. : АДС УМК Центр, 2011. – 267 с.

13. Сохацька О.М. Фінансовий інжиніринг: навчальний посібник / За ред. О.М. Сохацької.- К.: Кондор, 2011.- 660 с.

14. Торгівля цінними паперами : підручник / [Грушко В. І. та ін.]. – К. : Ун-т економіки та права "КРОК", 2011. – 391 с.

15. Цінні папери: практикум : навч. посіб. / [В. Д. Базилевич та ін.]. – К. : Знання, 2013. – 791 с.

16. Державна комісія з цінних паперів та фондового ринку [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <http://www.ssmc.gov.ua>.

17. Ліцензійні умови провадження професійної діяльності на ринку цінних паперів : затверджено наказом Державного комітету з питань регуляторної політики та підприємництва, рішенням Державної комісії з цінних паперів та фондового ринку від 14.03.2001 р. № 49/60, редакція від 14.05.2013 р. [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <http://zakon4.rada.gov.ua/laws/show/z0857-13>.

18. Офіційний сайт Верховної Ради України [Електронний ресурс]. – Режим доступу : [www.rada.gov.ua](http://www.rada.gov.ua).

19. Офіційний сайт Національного банку України [Електронний ресурс]. – Режим доступу : [www.bank.gov.ua](http://www.bank.gov.ua).

20. Про державне регулювання ринку цінних паперів в Україні. Закон України від 30.10.1996 р.448/96-ВР, редакція від 11.10.2013 р. [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <http://zakon4.rada.gov.ua/laws/show/448/96>.

21. Про цінні папери та фондовий ринок. Закон України від 23.02.2006 р. №

3480-IV, редакція від 01.01.2014 р. [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <http://zakon4.rada.gov.ua/laws/show/3480-15>.

**Методи навчання.**

Лекції, практичні та лабораторні заняття з використанням інформаційних технологій.

**Методи оцінювання:**

- поточний контроль (опитування);
- підсумкова контрольна робота
- підсумковий контроль (залік).

**Мова навчання.** Українська.