Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0421U101241

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 29-04-2021

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Климкович Іван Валерійович
2. Klymkovych Ivan Valeriiovych

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: так

Шифр наукової спеціальності: 08.00.11

Назва наукової спеціальності: Математичні методи, моделі та інформаційні технології в економіці

Галузь / галузі знань: Не застосовується

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 23-04-2021

Спеціальність за освітою: Математика

Місце роботи здобувача:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д 20.051.12

Повне найменування юридичної особи: Коломийський інститут ДВНЗ "Прикарпатський національний університет імені Василя Стефаника"

Код за ЄДРПОУ: 25735101

Місцезнаходження: вул. Лисенка, 8, м. Коломия, Коломийський р-н., Івано-Франківська обл., 78200, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

IV. Відомості про підприємство, установу, організацію, в якій було виконано дисертацію

Повне найменування юридичної особи: Дрогобицький державний педагогічний університет імені Івана Франка

Код за ЄДРПОУ: 02125438

Місцезнаходження: вул. Івана Франка, буд. 24, м. Дрогобич, Дрогобицький р-н., Львівська обл., 82100, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.35.51

Тема дисертації:

1. Моделі оцінювання фінансової стійкості банківської системи.

2. Models for assessing the financial stability of the banking system.

Реферат/анотація:

1. У дисертації здійснено теоретичне узагальнення та нове вирішення наукової проблеми щодо розроблення методичних положень та відповідної системи економіко-математичних моделей оцінювання фінансової стійкості банківської системи, аналізу чинників, які спричиняють статистично значимий вплив на фінансову стійкість, застосування теорії катастроф для визначення зон фінансової нестабільності та дослідження причинно-наслідкових зв'язків між індикаторами фінансової стійкості. Запропоновано підхід до оцінювання Z-score, який відрізняється від традиційного підходу використанням співвідношення регулятивного капіталу до зважених за ризиком активів. Побудовано комплексний показник фінансової стійкості банківської системи на основі використання 24 індикаторів фінансової стійкості. Розроблено моделі катастроф типу

збірки на основі статистичних даних функціонування української банківської системи, які дозволяють визначити значення показників діяльності банківської системи, при яких можливими є катастрофічні скачки значення потенціальної функції, модальність та гістерезис. Побудовано ARMA моделі прогнозування значень Z-score, обчисленого на основі трьох різних підходів та прогнозування комплексного показника фінансової стійкості. Побудовано схема напрямків причинно-наслідкового зв'язку між 24 індексами фінансової стійкості банківської системи України.

2. The dissertation provides a theoretical generalization and a new solution to a scientific problem on the development of methodological provisions and the corresponding system of economic and mathematical models for assessing the financial stability of the banking system, analysis of factors that cause a statistically significant impact on financial stability, the application of the theory of catastrophes to identify areas of financial instability and study of cause links between indicators of financial stability. An approach to assessing the Z-score is proposed, which differs from the traditional approach by using the ratio of regulatory capital to risk-weighted assets. A comprehensive indicator of the financial stability of the banking system was built on the basis of the use of 24 indicators of financial stability. The models of cusp catastrophes have been developed on the basis of statistical data on the functioning of the Ukrainian banking system and make it possible to determine the values of indicators of the banking system, at which catastrophic jumps in the value of the potential function, modality and hysteresis are possible. The ARMA model of forecasting the values of the Z-score, calculated on the basis of three different approaches and forecasting the complex indicator of financial stability were built. A diagram of directions of a causal relationship between 24 indices of financial stability of the banking system of Ukraine has been built.

Державний реєстраційний номер ДіР:

Пріоритетний напрям розвитку науки і техніки:

Стратегічний пріоритетний напрям інноваційної діяльності:

Підсумки дослідження:

Публікації:

Наукова (науково-технічна) продукція:

Соціально-економічна спрямованість:

Охоронні документи на ОПІВ:

Впровадження результатів дисертації:

Зв'язок з науковими темами:

VI. Відомості про наукового керівника/керівників (консультанта)

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Кишакевич Богдан Юрійович
2. Kyshakevych Bohdan Yuriiovych

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.11

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

VII. Відомості про офіційних опонентів та рецензентів

Офіційні опоненти

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Григорук Павло Михайлович
2. Hryhoruk Pavlo M.

Кваліфікація: д. е. н., 08.00.11

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Пілько Андрій Дмитрович
2. Pilko Andrii Dmytrovych

Кваліфікація: к.е.н., 08.03.02

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Рецензенти

VIII. Заключні відомості

Власне Прізвище Ім'я По-батькові голови ради	Благун Іван Семенович
Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні	Благун Іван Семенович
Відповідальний за підготовку облікових документів	
Реєстратор	
Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності	Юрченко Т.А.