Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0417U002225

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 08-06-2017

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Лучаківський Андрій Олегович

2. Luchakivskyy Andriy Olehovych

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: 15-05-2017

Спеціальність за освітою: 8.050100

Місце роботи здобувача: ПАТ АКБ “Львів”

Код за ЄДРПОУ: 09801546

Місцезнаходження: 79008 Україна, м. Львів, вул. Сербська, 1

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство фінансів України

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: 82100, м. Дрогобич, вул. Івана Франка, 24

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.73.02

Тема дисертації:

1. Економіко-математичні моделі оцінювання фінансової стійкості банку.

2. Economic and mathematical models of bank financial stability assessment.

Реферат/анотація:

1. Дисертація присвячена розробці економіко-математичних моделей оцінювання, моніторингу та оптимізації фінансової стійкості банку на основі застосування багатофакторного, сценарного та імітаційного моделювання та використання концепції економічного капіталу. Запропоновано концептуальний підхід та розроблено відповідний математичний інструментарій оцінювання фінансової стійкості банків у вигляді скалярної міри із застосуванням засобів інтегрального числення до результатів стрес-тестування банку на основі розробленої Z-score моделі. Побудовані бінарна та неперервна задачі багатокритеріальної оптимізації полягають у знаходженні Парето-ефективних портфелів активів та пасивів для цільових функцій та обмежень, які характеризують такі складові фінансової стійкості банку як достатність капіталу, ліквідність, якість пасивів, якість активів, рівень їх концентрації,прибутковість та ризик. Запропонована модель

оцінювання економічного капіталу на покриття процентного ризику ґрунтується на використанні VaR методології та елементів GAP аналізу. Розроблено індекс фінансової стійкості банку, в основу якого покладено порівняння розміру регулятивного капіталу із економічним капіталом, який призначений для покриття непередбачуваних збитків від банківських ризиків.

2. The thesis is devoted to developing economic and mathematical models of evaluation, monitoring and optimization of the bank financial stability on the base of the use of multivariate, scenario and simulation concepts and estimation of economic capital. Built in the model of Z-score evaluation allows to estimate the financial stability and solvency of the first group of the largest banks in Ukraine. The conceptual approach and mathematical tools for assessment of bank financial stability in form of a scalar measure were developed in work. They are based on the application of integral calculus to the results of the bank stress tests. The binary and continuous problem of multi-objective optimization aimed to find a Pareto-efficient portfolios of assets and liabilities were built. They consist the seven objective functions and six constraints that characterize such components of the financial stability of the bank as capital adequacy, liquidity, quality passives, asset quality, the level of concentration, profitability and risk. Methods successive concessions and ? - constraints were used for realization of the different types of bank strategies through the formation of Pareto-optimal banking portfolios. The model of assessment of economic capital to cover interest rate risk is based on the use of VaR methodology and elements of GAP analysis. In work the new index of financial stability of the bank which is based on comparison of regulatory capital with economic capital, which is intended to cover unforeseen losses from bank risks was developed.

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. Kushakevych Bohdan Yurijovych

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. Вітлінський Вальдемар Володимирович
2. Вітлінський Вальдемар Володимирович

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. Панасенко Оксана Володимирівна
2. Панасенко Оксана Володимирівна

Кваліфікація: к.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

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.