Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0412U000967

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 26-04-2012

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Львовський Леонід Янович

2. Lvovskiy Leonid Yanovich

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: ні

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: 28-03-2012

Спеціальність за освітою: 7.050104

Місце роботи здобувача: Приватне акціонерне товариство "Донецьксталь - металургійний завод"

Код за ЄДРПОУ: 30939178

Місцезнаходження: 83062, м. Донецьк, вул. Івана Ткаченка, 122

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство промислової політики України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д 11.051.01

Повне найменування юридичної особи:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

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

Повне найменування юридичної особи: Донецький національний університет імені Василя Стуса

Код за ЄДРПОУ: 02070803

Місцезнаходження: 21021, м.Вінниця, вул. 600-річчя, 21

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.35.51

Тема дисертації:

1. Моделювання управління кредитним ризиком комерційного банку

2. Modeling of commercial bank credit risk management

Реферат/анотація:

1. Об'єкт дослідження: процеси запобігання виникненню кредитного ризику в комерційному банку. Мета дослідження: розробка комплексу моделей і методів управління кредитним ризиком комерційного банку, що забезпечують стійкість банку і ефективне його функціонування при значних змінах в умовах зовнішнього середовища. Методи дослідження: економіко-математичне моделювання, імітаційне моделювання, статистичний аналіз, нейронні мережі, аналіз процесів кредитування і страхування. Результати: визначення особливостей кредитних операцій комерційних банків України в сучасних умовах; визначення специфічних методів оцінки кредитного ризику та прийняття рішення щодо видачі кредиту; розроблену концепцію моделювання управління кредитним ризиком комерційного банку; розроблену комбіновану модель оцінки платоспроможності позичальника; розроблену імітаційну модель ідентифікації виникнення кредитного ризику; розроблену імітаційну модель зміни фінансового стану позичальника в кризових умовах; розроблену модель прийняття оптимального рішення щодо вибору параметрів страхування кредитних ризиків; розроблену модель ведення кредитного процесу і роботи з проблемною заборгованістю. Новизна: Вперше

розроблено: концепцію моделювання управління кредитним ризиком комерційного банку; імітаційну модель ідентифікації виникнення кредитного ризику; імітаційну модель зміни фінансового стану позичальника в кризових умовах. Вдосконалено: комбіновану модель оцінки платоспроможності позичальника. Дістала подальшого розвитку: модель прийняття оптимального рішення щодо вибору параметрів страхування кредитних ризиків. Область використання: галузева.

2. Object of research: processes of prevention of origin of credit risk in a commercial bank. Purpose of research: development of complex of models and management methods by the credit risk of commercial bank, that provides stability of bank and his effective functioning at considerable changes in the conditions of external environment. Methods of research: economical and mathematical modeling, imitation modeling, statistical analysis, neuron networks, analysis of processes of crediting and insurance. Results: determination of features of credit operations of commercial banks of Ukraine in modern terms; determination of specific methods of estimation of credit risk and making decision in relation to delivery of credit; conception of design of management is worked out by the credit risk of commercial bank; the combined model of estimation of solvency of borrower is worked out; the simulation model of authentication of origin of credit risk is worked out; the simulation model of change of the financial state of borrower is worked out in crisis terms; the model of acceptance of optimal decision is worked out in relation to the choice of parameters of insurance of credit risks; the model of conduct of credit process and work is worked out with a problem debt. Novelty: it is First worked out : conception of design of management by the credit risk of commercial bank; simulation model of authentication of origin of credit risk; a simulation model of change of the financial state of borrower is in crisis terms. Improved: the combined model of estimation of solvency of borrower. Got further development: model of acceptance of optimal decision in relation to the choice of parameters of insurance of credit risks. Field of the use: of particular a branch.

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. Овечко Галина Сергіївна

2. Ovechko Galina Sergeevna

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

VII. Відомості про офіційних опонентів та рецензентів

Офіційні опоненти

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Сергєєва Людмила Нільсівна
2. Сергєєва Людмила Нільсівна

Кваліфікація: д.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

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Бобков Ігор Вікторович
2. Бобков Ігор Вікторович

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	Лисенко Юрій Григорович
Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні	Лисенко Юрій Григорович
Відповідальний за підготовку облікових документів	
Реєстратор	
Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності	Юрченко Т.А.