Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0414U004370

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 21-10-2014

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Писанець Костянтин Костянтинович

2. Pysanets Konstantin Konstantinovich

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: 30-09-2014

Спеціальність за освітою: 8.03050201

Місце роботи здобувача: Київський національний університет технологій та дизайну

Код за ЄДРПОУ: 02070890

Місцезнаходження: 01011, м. Київ-11, вул. Немировича-Данченка, 2

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д 26.001.48

Повне найменування юридичної особи: Київський національний університет імені Тараса Шевченка

Код за ЄДРПОУ: 02070944

Місцезнаходження: вул. Володимирська, 60, м. Київ, Київська обл., 01033, 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: Київський національний університет імені Тараса Шевченка

Код за ЄДРПОУ: 02070944

Місцезнаходження: 01033, м. Київ, вул. Володимирська, 64

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. Економіко-математичне моделювання скорингових систем оцінки позичальників.

2. Economic and mathematical modelling of scoring systems for borrower estimation.

Реферат/анотація:

1. У дисертаційній роботі здійснено постановку та запропоновано вирішення актуальної проблеми оцінки динаміки кредитних ризиків позичальників за допомогою скорингових систем, в межах якої розроблено комплекс економіко-математичних моделей, які дозволяють підвищити якість кредитних рішень. Запропоновано підходи до управління ризиками з використанням кривої відтинання, що дозволяють формувати ефективні стратегії споживчого кредитування: максимізацію доходу, зниження ризику, нарощення кредитного портфеля. У роботі вдосконалено методологічний підхід для прийняття рішень у кредитному ризик-менеджменті шляхом використання показника LTV (life time value) та процедури ідентифікації факторів кредитного ризику шляхом оцінки динаміки показника інформаційної значимості (IV). Виявлено асиметричність розподілу часу прояву кредитного ризику. Оцінено ступінь інтегрального впливу сукупності факторів ризиків у споживчому сегменті кредитного ринку з урахуванням їх взаємозв'язків.

2. In the thesis is settled and proposed solution of an actual problem of borrowers' credit risks dynamics estimation via scoring systems, in scope of which the complex of economic-mathematical models which allow to increase credit decisions quality are developed. It is proposed the methodological approach of risk management using cut-off curve, which allows to form effective lending strategies: profit maximization, risk reduction, credit portfolio size increase. The thesis deals with decision making methodological approach improvement in credit risk-management using LTV (life time value) indicator and credit risk factors identification procedures by means of information value (IV) dynamic estimation. Asymmetry of credit risk appearance time is found. The level of integral influence of the set of risk factors is estimated with consideration of their interconnection in consumer segment of credit market. Implementation of developed models of borrowers' credit risk dynamics estimation is done for the stage of loans issuance and stage of overdue loans recovery. Collection management processes optimization problem is solved.

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. Камінський Андрій Борисович
2. Kaminskiy Andrey Borisovich

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. Матвійчук Андрій Вікторович

2. Матвійчук Андрій Вікторович

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. Середюк Володимир Богданович

2. Середюк Володимир Богданович

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 Черняк Олександр Іванович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Черняк Олександр Іванович

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Т.А.