Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0419U003353

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 05-07-2019

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Шльончак Василь Васильович
2. Shlonchak Vasyl V.

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: так

Шифр наукової спеціальності: 08.00.08

Назва наукової спеціальності: Гроші, фінанси і кредит

Галузь / галузі знань: Не застосовується

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 24-06-2019

Спеціальність за освітою: 8.03050802 Банківська справа

Місце роботи здобувача: Товариство з обмеженою відповідальністю "Ернст енд Янг аудиторські послуги"

Код за ЄДРПОУ: 33306921

Місцезнаходження: вул. Хрещатик, буд. 19-А, м. Київ, Київ, 01001, Україна

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д 26.883.01

Повне найменування юридичної особи: Державний вищий навчальний заклад "Університет банківської справи"

Код за ЄДРПОУ: 34716922

Місцезнаходження: вул. Андріївська, 1, м. Київ, Київська обл., 04070, 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: Державний вищий навчальний заклад "Університет банківської справи"

Код за ЄДРПОУ: 34716922

Місцезнаходження: вул. Андріївська, 1, м. Київ, Київська обл., 04070, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.71.25, 06.73.75

Тема дисертації:

1. Ефективність кредитно-інвестиційної діяльності банків в умовах нестабільності банківської системи України

2. Efficiency of lending and investment banking of banks in conditions of instability of Ukrainian banking system

Реферат/анотація:

1. Проведено теоретичне узагальнення і запропоновано вирішення актуального наукового завдання, що полягає в поглибленні теоретико-методологічних засад, розвитку методичних підходів та розробленні практичних рекомендацій щодо підвищення ефективності КІД банків в умовах нестабільності функціонування банківської системи. Проаналізовано наукові підходи до визначення сутності дефініції «ефективність кредитно-інвестиційної діяльності банку» та обгрунтовано власне трактування даного поняття. Вказано перелік відмінностей між КІД та сукупністю кредитної та інвестиційної діяльності. Розроблено класифікацію типів ефективності КІД відповідно до основних ознак, які враховують її здатність до реплікації, мінливість, еластичність та інші ознаки. Виокремлено види ризиків, які супроводжують процес кредитно-інвестиційної діяльності банків. Обгрунтовано взаємозв'язок між рівнем ефективності КІД та

рівнем прийнятого ризику. Визначено перелік факторів невизначеності, які впливають на КІД банку, та їх зв'язок із фактором нестабільності. Проведено оцінку ефективності КІД банків в умовах нестабільності з використанням авторського комплексного підходу. З метою об'єктивного аналізу сформовано вибірку представників різних банківських груп на основі рівня їх впливу на діяльність банківської системи та показників ефективності діяльності. Запропоновано удосконалену систему показників оцінки ефективності КІД як основу для застосування методу інтегральної оцінки. В межах підходу розроблено коефіцієнти, які характеризують різні аспекти ефективності КІД та вплив фактора нестабільності. Виявлено основні фактори впливу на обсяги КІП. Розроблено підхід динамічного аналізу ризику КІД банків. Надано рекомендації щодо формування та оптимізації структури КІП банків в умовах нестабільності. Поділ діяльності банку на цикли дозволив виокремити вплив факторів невизначеності, що в сукупності призвели до впливу фактора нестабільності. На основі економіко-математичного моделювання розроблено підхід до оптимального формування інвестиційного портфеля, який передбачає циклічний попит банку та враховує реакцію інших учасників ринку. Розроблена модель дозволяє виявити оптимальний обсяг цінних паперів, які банк має придбати протягом визначеного періоду часу, що дозволяє отримати максимальний рівень ефективності КІД.

2. We made theoretical generalization in PhD thesis and proposed solution for scientific problem having significant importance. It is related to deepening of theoretical and methodological principles and development of methodological approaches as well as finding practical solutions to allow for improvement of efficiency of lending and investment banking (abbreviation LIB) in conditions of banking system instability. It has been proved that appliances of economic and mathematical approaches allows to identify factors having lead to decrease of LIB efficiency. Application of methodology based on integral assessment calculations allows for obtaining relevant data by customizing analytical tools to analysis purposes. One of the major advantages of the methodology is ability to adjust activity in short and long term periods. Ability to get comparative data by using benchmark indicators allows for accurate analysis by taking into consideration impact that external economic environment has on LIB efficiency ratio for banks. To evaluate risks of lending and investment banking the approach of dynamic risk analysis of LIB has been developed taking into consideration advantages of method of regulatory index assessment. It also involves calculations of LIB riskiness indicators as well as calculation of dynamic step-by-step effect. Calculated effect allows for accurate measurement of change of LIB riskiness rate as well as its comparison within periods of investigation. Application of Integral assessment method in conjunction with dynamic analysis method allowed for accurate analysis of efficiency and riskiness of LIB of Ukrainian banks as well as it supplemented providing recommendations with higher degree of objectivity. During empirical investigation it has been proved that the highest efficiency ratio of investment banking is achieved under conditions of cyclical portfolio formation. Applying economic and mathematical modelling the approach to optimal investment portfolio formation has been developed. It is based on cyclical bank demand and evaluates impact that other market participants make. The instability factor's impact is considered to be the complex impact that set of uncertainty factors makes on LIB efficiency. The model allows for identification of the optimal amount of securities that the bank should buy during certain time period that leads to obtaining maximum LIB efficiency ratio because of optimization of expected coupon payment amount and the asset's price.

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. Кузнєцова Анжела Ярославівна

2. Kuznietsova Anzhela Ya.

Кваліфікація: д. е. н., 08.01.01, 08.04.01

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. Лєонов Сергій Вячеславович

2. Lieonov Serhiy V.

Кваліфікація: д. е. н., 08.00.08

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. Черкашина Катерина Федорівна

2. Cherkashyna Ekateryna F.

Кваліфікація: к. е. н., 08.00.08

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 — Барановський Олександр Іванович

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

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності — Юрченко Т.А.