Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0412U006403

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 12-12-2012

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Товкач Вікторія Анатоліївна
2. Tovkach Viktoriia Anatoliivna

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: 19-11-2012

Спеціальність за освітою: 6.030502

Місце роботи здобувача: Публічне акціонерне товариство "АВАНТ-БАНК"

Код за ЄДРПОУ: 36406512

Місцезнаходження: 03110, м. Київ, вул. Івана Клименка, буд. 23

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д26.006.07

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: Державний вищий навчальний заклад "Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана"

Код за ЄДРПОУ: 02070884

Місцезнаходження: 03680, м.Київ, пр.Перемоги, 54/1

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. Моделювання та управління портфелем фінансових інвестицій комерційного банку

2. Modeling and managing the commercial bank's financial instruments portfolio

Реферат/анотація:

1. Дисертація містить результати дослідження і розбудови концептуальних положень та інструментарію математичного моделювання портфеля фінансових інвестицій комерційного банку. Зокрема, розроблено комплекс економіко-математичних моделей оптимізації портфелів фінансових інвестицій комерційного банку (торгового, на продаж та до погашення), які враховують такі характеристики, як очікувана дохідність портфеля, ступінь сукупного портфельного ризику та рівень ліквідності, вплив банківських інвестицій в цінні папери на основні нормативні показники діяльності банку, регулятивний капітал банку, суму резерву, що підлягатиме формуванню банком за інвестицією в цінні папери, та інше. Оптимізація портфелів цінних паперів комерційного банку здійснюється за допомогою методів багатокритеріальної оптимізації, що дозволяє підвищити якість результатів моделювання.

2. The Dissertation contains the results of the conceptual provisions and tools of mathematical modeling of the commercial bank's financial investments portfolio. In particular, a mathematical economic models' complex to

optimize commercial bank's financial investment portfolios (commercial, for sale and to maturity) was developed. This models' complex takes into account such things as the expected return of the portfolio, the degree of aggregate portfolio risk and liquidity level, the impact of bank investments in securities for major performance standards, bank regulatory capital, the reserve amount that should be formatted by bank for its investments in securities. Optimization of commercial banks' portfolios is done by using multiobjective optimization methods that can improve the simulation results' quality.

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. Великоіваненко Галина Іванівна
2. Velikoivanenko Galina Ivanivna

Кваліфікація: к.ф.-м.н., 01.01.05

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. Кишакевич Богдан Юрійович

2. Кишакевич Богдан Юрійович

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. Степаненко Ольга Петрівна

2. Степаненко Ольга Петрівна

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 Вітлінський Вальдемар Володимирович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Вітлінський Вальдемар Володимирович

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Т.А.