Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0419U004680

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 01-11-2019

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Белянко Лідія Леонідівна

2. Belianko Lidiia L.

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: 31-10-2019

Спеціальність за освітою: Банківська справа

Місце роботи здобувача: Київський національний торговельно-економічний університет

Код за ЄДРПОУ: 01566117

Місцезнаходження: вул. Кіото, 19, м. Київ, Київська обл., 02156, Україна

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 26.055.03

Повне найменування юридичної особи: Київський національний торговельно-економічний університет

Код за ЄДРПОУ: 01566117

Місцезнаходження: вул. Кіото, 19, м. Київ, Київська обл., 02156, 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 торговельно-економічний університет

Код за ЄДРПОУ: 01566117

Місцезнаходження: вул. Кіото, 19, м. Київ, Київська обл., 02156, 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. Стрес-тестування кредитного ризику банків
2. Stress-testing of credit risk of banks

Реферат/анотація:

1. Розкрито теоретичну модель стрес-тестування кредитного ризику з визначенням його необхідності, сутності, особливостей, мети, принципів та завдань. Запропоновано класифікацію інструментарію стрес-тестування кредитного ризику завдяки виокремленню таких ознак, як рівень проведення та масштаб охоплення факторів впливу, що сприятиме подальшому розвитку теоретичних основ та формуванню практичних рекомендацій щодо стрес-тестування кредитного ризику банків. Дістало подальшого розвитку положення щодо побудови матриці впливу зовнішніх факторів на його рівень, яка визначає зони несуттєвого, середнього та високого ступеня впливу змінних параметрів, що дозволяє прогнозувати зміну рівня кредитного ризику внаслідок волатильності макроекономічних та монетарних чинників. Виокремлено етапи розвитку практики застосування стрес-тестування у банках. Визначено послідовність проведення стрес-тестування кредитного ризику банків. Розроблено методичні засади оцінювання дії макроекономічних

факторів на кредитний ризик банків на основі побудови економіко-математичних моделей, використання яких дозволить виявити найбільш значимі індикатори довгострокового впливу та враховувати їх в процесі прийняття управлінських рішень. Удосконалено інформаційне і методичне забезпечення стрес-тестування кредитного ризику, зокрема, рекомендовано ввести нову примітку до річної фінансової звітності «Стрес-тестування кредитного ризику, а також нові форми статистичної й управлінської звітності за його результатами. Представлено методичні рекомендації стосовно порядку проведення стрес-тестування кредитного ризику у банках, сприятиме які спрямовані на підвищення якості його організації та моніторингу.

2. The theoretical model of stress-testing of credit risk with the definition of its necessity, essence, features, purpose, principles and tasks is formed. The classification of stress-testing tools for credit risk has been improved by distinguishing such features as the level of conduct and the extent of coverage of factors of influence, which will further develop the theoretical foundations and formulate practical recommendations for stress-testing of credit risk of banks. The methodology for analyzing credit risk of banks by constructing a matrix of influence of external factors on its level, which defines zones of insignificant, medium and high degree of influence of variable parameters, which allows to predict the change in the level of credit risk due to the volatility of macroeconomic and monetary factors, has been improved. The stages of development of the practice of stress-testing in banks are singled out. The sequence of conducting stress-testing of credit risk of banks is determined. The methodical principles of assessing the impact of macroeconomic factors on credit risk of banks on the basis of constructing economic and mathematical models, which will allow the most significant indicators of long-term influence to be identified and taken into account in the process of making managerial decisions, have been improved. Improved informational and methodological support for stress-testing of credit risk, in particular, it is recommended to introduce a new note to the annual financial statements «Stress-testing of credit risk», as well as new forms of statistical and managerial reporting based on its results. The methodical recommendations concerning the order of conducting stress-testing of credit risk in banks are offered, which will promote improvement of the quality of its organization and monitoring.

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. Шульга Наталія Петрівна

2. Shulha Nataliia P.

Кваліфікація: д. е. н., 08.06.01

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. Тригуб Олена Володимирівна
2. Trygub Olena V.

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

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Кузнєцова Людмила Вікторівна
2. Kuznietsova Liudmyla 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

Рецензенти

VIII. Заключні відомості

Власне Прізвище Ім'я По-батькові голови ради Запатріна Ірина Вікторівна

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Волосович Світлана Василівна

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

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