Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0511U000993

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 26-12-2011

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Кишакевич Богдан Юрійович
2. Kyshakevych Bogdan Yuriyovych

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: доктор 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: 02-12-2011

Спеціальність за освітою: 7.080202

Місце роботи здобувача: Дрогобицький державний педагогічний університет імені Івана Франка

Код за ЄДРПОУ: 02125438

Місцезнаходження: 82100, м. Дрогобич, вул. Івана Франка, 24

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти України

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: Дрогобицький державний педагогічний університет імені Івана Франка

Код за ЄДРПОУ: 02125438

Місцезнаходження: 82100, м. Дрогобич, вул. Івана Франка, 24

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. Економіко-математичне моделювання кредитних ризиків банку

2. Economic and mathematical modeling of bank credit risk

Реферат/анотація:

1. Дисертація присвячена розробці економіко-математичних моделей оцінювання економічного капіталу, рівня концентрації кредитного ризику, оптимізації кредитного портфеля банку та оцінювання основних параметрів кредитного ризику: ймовірності дефолту та втрат при дефолті. Розроблено методологічні основи та математичний інструментарій оцінювання кредитоспроможності та ймовірності банкрутства позичальника, які дають змогу банкам визначити ймовірність дефолту та потенційний кредитний рейтинг позичальника на основі національної рейтингової шкали. У роботі запропоновано підхід до визначення економічного капіталу банку на основі методу симуляцій Монте-Карло із використанням моделей скорочених форм та блукаючих дефолтів. Запропоновано нові міри концентрації кредитного ризику та модифікації індексу Херфіндаля - Хіршмана (HHI), які враховують не лише питому вагу кожної позики, але й кредитний рейтинг позичальників. Пропонується підхід до вимірювання рівня концентрації кредитного ризику портфеля, який ґрунтується на застосуванні гомогенних мір ризику, таких як середньоквадратичне

відхилення, VaR, CVaR. Розроблено концепцію факторної концентрації кредитного ризику, в основі якої лежить визначення внеску кожного систематичного фактору у сукупний ризик портфеля.

2. Dissertation is devoted to development of economic and mathematic models of economic capital calculation, credit risk concentration, optimization of credit portfolio and evaluation of the main credit risk parameters such as probability of default and loss given default. Models of creditworthiness and probability of default evaluation were created. They allow banks to estimate probability of default and credit rating of borrower on the base of national rating scale. Methodology of economic capital estimation by means of Monte-Carlo simulation, models of reduced forms and wandering defaults was offered. New credit risk concentration measures were created as well as modifications of Herfindahl-Hirschman Index (HHI). They take into account not only share of loans but credit rating of borrowers. New approach for calculation of credit risk concentration based on the usage of homogenous risk measures such as standard deviation, VaR, CVaR was offered. The concept of credit risk factor concentration was proponed. It is based on calculation of the contribution of the systematic factor into portfolio credit risk.

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. Єлейко Василь Іванович

2. Yeleyko Vasyl Ivanovych

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. Порохня Василь Михайлович

2. Порохня Василь Михайлович

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. Скрипниченко Марія Іллівна

2. Скрипниченко Марія Іллівна

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. Христіановський Вадим Володимирович

2. Христіановський Вадим Володимирович

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

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.