

Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0417U004011

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 26-10-2017

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:



II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Кушнір Олескандр Сергійович

2. Kushnir Oleksandr Serhiiovych

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: 28-09-2017

Спеціальність за освітою: 8.050201

Місце роботи здобувача:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д 20.051.12

Повне найменування юридичної особи: Коломийський інститут ДВНЗ "Прикарпатський національний університет імені Василя Стефаника"

Код за ЄДРПОУ: 25735101

Місцезнаходження: вул. Лисенка, 8, м. Коломия, Коломийський р-н., Івано-Франківська обл., 78200, 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: ДВНЗ "Прикарпатський національний університет імені Василя Стефаника"

Код за ЄДРПОУ: 02125266

Місцезнаходження: 76018, Україна, м.Івано-Франківськ, вул.Шевченка, 57

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.73.75

Тема дисертації:

1. Моделі оцінки операційних ризиків банку.
2. Models of estimation of operational risks of a bank.

Реферат:

1. Дисертація присвячена дослідженню теоретико-методичних положень і практичних рекомендацій щодо оцінки операційних ризиків з врахуванням розподілу економічного капіталу за ризик-інцидентами банку. Запропоновано концептуальний підхід до оцінки операційних ризиків банку на основі комплексу економіко-математичних моделей, який базується на досвіді іноземних банківських установ та положень Базельського комітету та адаптований під українські реалії банківського сектору. Це дало змогу визначити рівень можливих фінансових втрат, спричинених цими ризиками банківським установам. Удосконалено математичний інструментарій розподілу економічного капіталу за ризик-інцидентами банківської установи з метою підвищення ефективності управління його операційними ризиками, що дозволяє визначити власні кошти банку, достатні для покриття потенційних збитків при заданому рівні толерантності до операційного

ризиків для конкретного часового горизонту. Удосконалено та апробовано моделі оцінки операційного ризику на основі підходу АМА (Advanced Measurement Approach), що дозволяють конкретизувати і деталізувати розрахунки за окремими напрямками діяльності банку (бізнес-лініями) і для певного типу операційних витрат (ризик-інцидентів), встановлених для кожного з напрямків. Запропоновано інструментарій прогнозування величини операційних ризиків і економічного капіталу банку на основі застосування нейромережевого моделювання в поєднанні з побудовою раціональних сплайнів, що дозволяє поліпшити аналітичні можливості розрахованих прогнозних значень операційних ризиків і дає можливість формувати по ним оптимальну для тимчасового ряду адаптивну стратегію, яка потребує апріорної інформації про структуру шуканої функціональної залежності.

2. The dissertation is devoted to the study of theoretical and methodological provisions and practical recommendations on the assessment of operational risks, taking into account the distribution of economic capital for risk-incidents of the bank. A conceptual approach to the assessment of the bank's operational risks based on a set of economic and mathematical models based on the experience of foreign banking institutions and the provisions of the Basel Committee and adapted to the Ukrainian realities of the banking sector is proposed. This made it possible to determine the level of possible financial losses caused by these risks by banking institutions. The mathematical toolkit of distribution of economic capital for risk incidents of a banking institution with the purpose of increasing the efficiency of management of its operational risks has been improved, allowing to determine the bank's own funds sufficient to cover potential losses at a given level of operational risk tolerance for a particular time horizon. The models of operational risk assessment based on the AMA (Advanced Measurement Approach) approach have been improved and tested, allowing to specify and detail the calculations for certain lines of business of the bank (business lines) and for a certain type of operational losses (risk incidents) established for each of the directions. The toolkit for forecasting the magnitude of operational risks and economic capital of the bank based on the application of neural network modelling in conjunction with the construction of rational splines is proposed, which allows improving the analytical capabilities of the calculated forecasted values of operational risks and enabling them to form an optimal adaptive strategy based on them that does not require a priori information on the structure desired functional dependence.

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 ОПВ:

Впровадження результатів дисертації:

Зв'язок з науковими темами:

VI. Відомості про наукового керівника/керівників (консультанта)

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Дмитришин Леся Ігорівна

2. Dmytryshyn Lesya Ihorivna

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. Ляшенко Олена Ігорівна

2. Ляшенко Олена Ігорівна

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. Чаговець Любов Олексіївна

2. Чаговець Любов Олексіївна

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**

Благун Іван Семенович

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові
головуючого на засіданні**

Благун Іван Семенович

**Відповідальний за підготовку
облікових документів**

Реєстратор

**Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є
відповідальним за реєстрацію наукової
діяльності**



Юрченко Т.А.