Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0412U002391

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 17-05-2012

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Афанасенко Марина Валеріївна
2. Afanasenko Maryna Valerijivna

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: 19-04-2012

Спеціальність за освітою: 8.050105

Місце роботи здобувача: Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця

Код за ЄДРПОУ: 02071211

Місцезнаходження: 61166, м. Харків, проспект Науки, 9 а

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): К 64.055.02

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: Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця

Код за ЄДРПОУ: 02071211

Місцезнаходження: 61166, м. Харків, проспект Науки, 9 а

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.73.07

Тема дисертації:

1. Рейтингова оцінка діяльності банків та їх підрозділів

2. Rating evaluation of activity of banks and their branches

Реферат/анотація:

1. Об’єкт дослідження: процес оцінки діяльності банків та їх підрозділів, якими є філіали та відділення банків; мета роботи: розвиток теоретичних положень і методичного забезпечення та розробка практичних рекомендацій з рейтингової оцінки діяльності банків та їх підрозділів з урахуванням фінансового стану; методи дослідження та апаратура: структурно-логічний аналіз, морфологічний аналіз, морфологічна декомпозиція, функціональний аналіз, аналіз та синтез, таксономічний аналіз, кластерний аналіз, дискримінантний аналіз, оболонковий аналіз даних (DEA); теоретичні і практичні результати: методичний підхід до рейтингової оцінки підрозділів банку особливістю якого є використання оптимізаційної моделі за вхідними параметрами оцінки: загальна кількість працівників, операційні витрати, рівень задоволення споживачів якістю обслуговування та вихідними параметрами: загальний обсяг кредитів та загальний обсяг депозитів за звітний період, що дозволяє порівняти витрати праці та капіталу підрозділу з обсягом здійснених у ньому операцій та визначити такий розмір вхідних показників, який дозволить підрозділу бути

на межі ефективності; методичне забезпечення ухвалення рішень щодо подальшого розвитку діяльності підрозділів банку на основі чотирьохквадрантної матриці, побудованої за запропонованим показником ефективності підрозділу та рівнем його прибутковості із зазначенням їх граничних значень, що підвищує обгрунтованість управлінських рішень; методичний підхід до рейтингової оцінки банків, що на відміну від існуючих передбачає їх оцінювання за оптимізаційною моделлю з такими вхідними показниками, як загальний обсяг депозитів банку, основних засобів та операційних витрат, та вихідними параметрами, що включають обсяг кредитного портфелю, інвестиційного портфелю, величину процентних доходів та непроцентних доходів; визначення поняття «рейтинг», відмінність якого полягає в його розумінні як комплексної порівняльної оцінки діяльності економічної системи з метою ухвалення управлінських рішень, що базується на даних фінансової звітності та експертних оцінках; процедуру класифікації банків, розробленої на основі проведення експерименту з їх розподілення на групи за такими класифікаційними ознаками як загальний розмір активів банку та інтелектуальний показник його фінансового стану; ступінь упровадження: розробки впроваджені в практичну діяльність ТОВ «Каліта-Фінанс», АТ «ПриватБанк», АТ «Брокбізнесбанк»; сфера використання: рейтингова оцінка діяльності банків та їх підрозділів

2. Object of research: process evaluation of the banks and their units, which are branches and subsidiaries of banks; objective: development of theoretical positions and methodological support and develop practical recommendations on the rating of banks and their units subject to the financial condition; methods and apparatus: structural and logical analysis, morphological analysis, morphological decomposition, functional analysis, and synthesis, taxonomic analysis, cluster analysis, discriminant analysis, shell analysis (DEA); theoretical and practical results: methodical approach to the rating of the bank feature of which is using an optimization model for the input parameters estimation: the total number of employees, operating expenses, the level of customer satisfaction quality of service and output parameters: total loans and total deposits during the reporting period that allows you to compare the costs of labor and capital unit of volume made it operations and define this size input parameters that will be on the verge of unit effectiveness; methodological support decisions on further development of activities of the bank based chotyrohkvadrantnoyi matrix, based on the proposed measure the effectiveness of the unit and its level of profitability with their boundary values, which increases the validity of administrative decisions, methodical approach to rating banks in contrast to the existing involves their estimation by optimization model input parameters such as total bank deposits, fixed assets and operating costs, and output parameters, including the amount of loan portfolio, the value interest income and non-interest income, the definition of "rating"; the difference consists in its sense as a comprehensive comparative evaluation of the economic system to management decisions based on data from financial statements and expert estimates; the procedure of classification of banks, developed on the basis of the experiment their distribution in groups such as classification attributes the overall size of bank assets and intellectual figure of his financial condition; the degree of implementation: design implemented in practice Ltd "World Finance" JSC "Privat", JSC "Brokbiznesbank"; scope: rating rating of banks and their units

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. Чмутова Ірина Миколаївна

2. Chmytova Iryna Mykolaivna

Кваліфікація: к.е.н., 08.06.02

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. Внукова Наталія Миколаївна

2. Внукова Наталія Миколаївна

Кваліфікація: д.е.н., 08.06.02

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. Котковський Володимир Станіславович

2. Котковський Володимир Станіславович

Кваліфікація: к.е.н., 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

Рецензенти

VIII. Заключні відомості

Власне Прізвище Ім'я По-батькові голови ради	Ястремська Олена Миколаївна
Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні	Ястремська Олена Миколаївна
Відповідальний за підготовку облікових документів	
Реєстратор	
Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності	Юрченко Т.А.