Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0414U003631

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 08-07-2014

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Ільченко Ксенія Олександрівна

2. Ilchenko Ksenua Oleksandrivna

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: 26-06-2014

Спеціальність за освітою: 8.030502

Місце роботи здобувача: Національний технічний університет України "Київський політехнічний інститут імені Ігоря Сікорського"

Код за ЄДРПОУ: 02070921

Місцезнаходження: 03056, м.Київ, пр.Перемоги, 37

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 73.138.02

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: Національний технічний університет України "Київський політехнічний інститут імені Ігоря Сікорського"

Код за ЄДРПОУ: 02070921

Місцезнаходження: 03056, м.Київ, пр.Перемоги, 37

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 кредитно-депозитної діяльності комерційного банку з урахуванням гудвілу
2. Modelling of lending and deposit-taking activities of commercial banks considering their goodwill

Реферат/анотація:

1. У дисертаційній роботі розроблено концептуальну модель кредитно-депозитної діяльності комерційного банку, яка враховує гудвіл і базується на формалізації зв'язку між показниками гудвілу, ліквідності та динаміки депозитів системою диференціальних рівнянь. Застосування моделі дає змогу підвищити ефективність діяльності банку.Розвинуто метод класифікації функцій обсягу кредитів, який базується на дослідженні ретроспективної динаміки. Запропоновано методичний підхід до оптимізації кредитно-депозитної діяльності банку щодо якого використовується модель кредитно-депозитної діяльності з урахуванням гудвілу, яка зводиться до двокритеріальної задачі оптимізації та дає можливість визначати ефективні ставки за кредитами і депозитами. Удосконалено методи визначення кредитних і депозитних ставок комерційного банку. Для визначення ставок запропоновано використовувати методи теорії ігор, а саме знаходження гарантованої стратегії та рівноваги за Нешем.Розвинуто методи пошуку оптимальних рішень для моделі в багатокритеріальній постановці за рахунок використання дискретного аналогу системи

диференціальних рівнянь і методи прийняття рішень в умовах досконалої конкуренції на ринку банківських послуг.

2. Conceptual model of lending and deposit-taking activities of commercial banks was developed in this thesis. The goodwill was taken into account. The model was based on the formalization of relationship between goodwill, liquidity and dynamics of deposit-taking activities by the system of differential equations. Model implementation allows to increase the effectiveness of the bank by developing its operation strategies.A method of classification of lending volumes functions based on a retrospective study of lending dynamics was developed. The methodical approach to the bank lending and deposit-taking activities optimization by using lending and deposit-taking activities model based on goodwill was described. The model includes multi-criteria optimization problem and makes it possible to determine the effective interest lending and deposit rates. Methods for determining the lending and deposit rates of commercial banks were improved. Methods of game theory, namely, guaranteed strategy finding and Nash equilibrium were offered for determining the rates. Method of optimization for the multi-criteria model using discrete analogue of differential equations was described. Methods of decision making under conditions of perfect competition in the banking market were described.

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. Капустян Володимир Омелянович
2. Kapustuan Vladimir Omeluanovich

Кваліфікація: д.ф.-м.н., 01.01.09

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. Камінський Андрій Борисович
2. Камінський Андрій Борисович

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. Негрей Марина Володимирівна
2. Негрей Марина Володимирівна

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 Казарінова Наталія Леонидівна

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні

Казарінова Наталія Леонидівна

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Т.А.