

# Облікова картка дисертації

## I. Загальні відомості

**Державний обліковий номер:** 0417U003771

**Особливі позначки:** відкрита

**Дата реєстрації:** 12-10-2017

**Статус:** Захищена

**Реквізити наказу МОН / наказу закладу:**



## II. Відомості про здобувача

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові:**

1. Біляєва Вікторія Юріївна
2. Biliaieva Viktoriia Yuriiivna

**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:** 28-09-2017

**Спеціальність за освітою:** 8.050802

**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):** Д 64.055.02

**Повне найменування юридичної особи:** Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця

**Код за ЄДРПОУ:** 02071211

**Місцезнаходження:** проспект Науки, 9-А, м. Харків, Харківський р-н., Харківська обл., 61166, 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:** 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. Забезпечення фінансової стійкості банку засобами фінансового інжинірингу
2. Ensuring a bank's financial soundness by means of financial engineering

**Реферат:**

1. Об'єкт дослідження: процес забезпечення фінансової стійкості банку; мета роботи: розвиток теоретичних і методичних положень та розроблення науково-практичних рекомендацій щодо забезпечення фінансової стійкості банку засобами фінансового інжинірингу; методи дослідження і апаратура: теоретичне узагальнення, аналіз та синтез, апріорне ранжування, класифікація, таксономічний аналіз, шкалювання за правилом «трьох сигм», метод «повного зв'язку», метод «центра ваги», кореляційно-регресійний аналіз, аналіз характеристик інтервальних рядів, метод «одноканального зв'язку», метод Уорда, дискримінантний аналіз, метод аналізу ієрархій (MAI), імітаційне моделювання (системно-динамічні моделі), графічний метод; теоретичні і практичні результати: методичне забезпечення, яке враховує специфіку певної стадії життєвого циклу банку й особливості його фінансової діяльності в процесі впровадження фінансових інновацій; основні концептуальні положення управління фінансовою стійкістю банку, які, на відміну від існуючих,

передбачають використання засобів фінансового інжинірингу для забезпечення фінансової стійкості банку; методичні положення щодо виявлення джерел реалізації резервів забезпечення фінансової стійкості банку, які, на відміну від існуючих, базуються на визначенні впливу банківських операцій на фінансову стійкість банку; методичний підхід до визначення рівня фінансової стійкості банку, відмінність якого від існуючих полягає у: застосуванні узагальненого показника фінансової стійкості, обчисленого за її складовими; визначенні якісного рівня фінансової стійкості банку за побудованими інтервальними шкалами; віднесенні банку до однорідної групи банків за рівнем фінансової стійкості; визначення поняття «фінансовий інжиніринг», відмінність якого від існуючих полягає у: виділенні забезпечення фінансової стійкості банку як однієї з цілей створення нових фінансових продуктів і послуг; визначенні фінансового інжинірингу як інструменту, а фінансових інновацій – як засобів забезпечення фінансової стійкості банку; класифікація фінансових інновацій у банку через введення додаткових класифікаційних ознак: «за стадією життєвого циклу банку» та «за рівнем фінансової стійкості банку»; інструментарій оцінювання ефективності впровадження фінансових інновацій, відмінність якого від існуючого полягає у поєднанні методів аналізу грошових потоків та показників ефективності інноваційних проєктів, що створює умови для оцінювання майбутнього ефекту від впровадження фінансових інновацій у діяльність банку та сприяє підвищенню якості управлінських рішень при виборі конкретних видів фінансових інновацій; ступінь упровадження: розробки впроваджені в практичну діяльність ПАТ «Східно-український банк «Грант», ПАТ КБ «Правекс-банк», ПАТ «Укрсоцбанк»; сфера використання: управління фінансовою стійкістю банку.

2. The object of research: the process of ensuring bank financial soundness; the purpose of the work: the development of theoretical and methodological provisions and the development of scientific and practical recommendations for ensuring bank financial soundness by the means of financial engineering; research methods and equipment: theoretical generalization, analysis and synthesis, a priori ranking, classification, taxonomic analysis, three-syllable scaling, complete linkage method, center-of-weight method, correlation-regression analysis, analysis of intervals, single-linkage method, Ward's method, discriminant analysis, hierarchy analysis method, simulation modeling, graphical method; theoretical and partisan results: methodical provision that takes into account the specifics of a certain stage of a bank's life cycle and the peculiarities of its financial activity in the process of introducing financial innovations; the main conceptual provisions of financial soundness management of a bank, which, in contrast to the existing ones, imply using financial engineering in order to ensure the bank financial soundness; methodical provisions for identifying sources of implementation of reserves for ensuring bank financial soundness, which, unlike existing ones, are based on the definition of the impact of banking operations on the bank financial soundness; methodical approach to determining the level of bank financial soundness, the difference of which from existing ones consists in: application of the generalized indicator of financial soundness, calculated on its components; determination of the qualitative level of bank financial soundness based on built interval scales; assigning the bank to a homogeneous group by the level of its financial soundness; definition of "financial engineering", which differs from existing ones and implies allocating bank financial soundness as one of the goals for creating new financial products and services; the definition of financial engineering as an instrument, and financial innovations – as a means of ensuring bank financial soundness; the classification of financial innovations in the bank through the introduction of additional classification features: "according to the stage of the life cycle of a bank" and "on the level of financial stability of a bank"; the toolkit for evaluating the effectiveness of introduced financial innovations, whose difference from existing one is in combining the methods of analysis of cash flows and indicators of the efficiency of innovative projects, which creates conditions for assessing the future effect of introducing financial innovations into the activities of a bank and contributes to improving the quality of management decisions when choosing specific types of financial innovations; the degree of implementation: developments implemented in the practical activities of PJSC "East-Ukrainian Bank Grant", PJSC CB «Pravex-Bank», PJSC «Ukrsotsbank»; sphere of use: management of bank financial soundness.

**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. Чмутова Ірина Миколаївна

2. Chmutova Iryna Mykolaivna

**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

## **VII. Відомості про офіційних опонентів та рецензентів**

**Офіційні опоненти**

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові:**

1. Самородов Борис Вадимович

2. Самородов Борис Вадимович

**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

**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.