Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Image not found or type unknow

Державний обліковий номер: 0413U001132

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 17-01-2013

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Урсуленко Ганна Василівна

2. Ursulenko Ganna Vasylivna

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: 20-12-2012

Спеціальність за освітою: 7.03050201

Місце роботи здобувача: Київський національний університет імені Тараса Шевченка

Код за ЄДРПОУ: 02070944

Місцезнаходження: 01033, м. Київ, вул. Володимирська, 64

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 26.001.13

Повне найменування юридичної особи: Київський національний університет імені Тараса Шевченка

Код за ЄДРПОУ: 02070944

Місцезнаходження: вул. Володимирська, 60, м. Київ, Київська обл., 01033, 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: Київський національний університет імені Тараса Шевченка

Код за ЄДРПОУ: 02070944

Місцезнаходження: 01033, м. Київ, вул. Володимирська, 64

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 банківських ризиків в умовах переходу до "Базеля II".

2. Banking risk modeling under condition of Basel II.

Реферат/анотація:

1. Дисертація присвячена дослідженню сучасних підходів до визначення й моделювання банківських ризиків. Проаналізовано економічну природу банківських ризиків з точки зору вітчизняного та міжнародного законодавства, доведено важливість їх застосування у банківській сфері. Розроблено моделі на основі байєсівського підходу до оцінювання та визначення ймовірності дефолту позичальника та мінімального розміру капіталу, що формується для покриття збитків від реалізації ризиків. У рамках байєсівського підходу розглянуто два варіанти моделювання кредитного ризику: підхід на основі моделювання методом Монте-Карло та ланцюгів Маркова (МКЛМ) та комплексна оцінка методом Лапласа (КОМЛ). На основі підходу МКЛМ розроблена методика байєсівського аналізу для моделювання кредитного ризику (застосування структурних моделей з шумами). Досліджено використання величини VaR щодо моделювання та оцінювання ринкових ризиків. Залежно від ймовірнісного розподілу факторів ризику та виду функціональної залежності

між зміною вартості портфеля та зміною факторів ризику розглянуто основні методи та моделі для обчислення величини VaR: модель постійних коваріацій; модель експоненціально-зважених коваріацій; GARCH-модель; модель теорії екстремальних значень. Обґрунтовано доцільність застосування кожної з моделей.

2. The thesis is devoted to the study of modern approaches to the banking risk definition and modeling. The economic nature of banking risks are analyzed in terms of domestic and international law, proved the importance of modeling in the banking sector. The thesis deals with the models based on the Bayesian approach to evaluating and determining the probability of default and minimum capital requirements. In the framework of the Bayesian approach, we consider two ways of modeling credit risk: an approach based on Monte Carlo Markov Chains approximation (MCMC) and Integrated Netscape Laplace Approximation (INLA). On the basis of the INLA approach the dissertation depicts the technique of Bayesian analysis for credit risk modeling (the use of structural models with noise). The thesis analyses using VaR for market risk modeling and evaluating. Depending on the probability distribution of risk factors and type of functional relationship between the change in value of the portfolio and changes in risk factors considered basic methods and models for calculating VaR: covariation model; GARCH-model, extreme theory model.

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. Черняк Олекчандр Іванович
2. Chernyak Olekchandr 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. Вітлінський Вальдемар Володимирович

2. Вітлінський Вальдемар 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

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Кишакевич Богдан Юрійович

2. Кишакевич Богдан Юрійович

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	Базилевич Віктор Дмитрович
Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні	Базилевич Віктор Дмитрович
Відповідальний за підготовку облікових документів	
Реєстратор	
Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності	Юрченко Т.А.