

Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0420U102446

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 29-12-2020

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:



II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Семенцов Руслан Володимирович

2. Sementsov Ruslan Volodymyrovych

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: 10-12-2020

Спеціальність за освітою: Банківська справа

Місце роботи здобувача: АКЦІОНЕРНЕ ТОВАРИСТВО "ПІРЕУС БАНК МКБ"

Код за ЄДРПОУ: 20034231

Місцезнаходження: вул.Білоруська, будинок 11, м. Київ, 04070, Україна

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д 26.883.01

Повне найменування юридичної особи: Університет банківської справи

Код за ЄДРПОУ: 34716922

Місцезнаходження: вул. Січових Стрільців, 11, м. Львів, Львівська обл., 79007, 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: Університет банківської справи

Код за ЄДРПОУ: 34716922

Місцезнаходження: вул. Січових Стрільців, 11, м. Львів, Львівська обл., 79007, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.73.55

Тема дисертації:

1. Діагностика фінансового стану комерційних банків
2. Commercial banks financial condition diagnostics

Реферат:

1. У дисертації уточнено теоретичні засади поняття “діагностика”, структурні елементи та істотні ознаки фінансового стану комерційних банків (далі КБ). Виокремлено основні структурні елементи процесу діагностики фінансового стану КБ, визначено систему діагностики фінансового стану КБ. Визначено відношення понять “фінансовий стан КБ” та “діагностика фінансового стану КБ”. Доведено доцільність використання підходу до визначення фінансового стану КБ, що базується на ймовірності дефолту конкретного банку. Основними результатами дослідження є розробка практичних рекомендацій до організації процесу діагностики фінансового стану КБ та створення методики визначення фінансового стану КБ за рахунок визначення показника ймовірності дефолту КБ шляхом дослідження банківського ринку, кластеризації КБ та визначення ризику дефолту конкретного банку на основі аналізу якості чистого грошового потоку КБ, фінансового стану КБ України. Уточнено загальний алгоритм діагностики фінансового стану КБ на основі стрес-тестування. Уточнено методику визначення ймовірності дефолту КБ, на основі кластеризації сукупності КБ шляхом визначення динаміки частки конкретного банку на ринку банківських

послуг, композиції елементів чистого грошового потоку від операційної, інвестиційної та фінансової діяльності КБ на основі показників фінансової звітності КБ України, індексу впливу конкретного банку на локальному ринку, що базується на принципах загальних положень теорії ймовірності.

2. The thesis clarifies the theoretical foundations of the concept of “diagnostics”; structural elements and essential features of the bank’s financial condition. The main structural elements of the process of diagnosing the financial condition of the bank are highlighted, the system for diagnosing the financial condition of the bank is determined. The relationship between the concepts “financial condition of the bank” and “diagnostics of the financial condition of the bank” has been determined. The approach to diagnostics of the bank’s financial condition based on the bank’s risk profile has been substantiated. The expediency of using an approach to determining the financial condition of a bank based on the probability of default of a particular bank has been proved. The categories and types of risks to which the bank is exposed, the approach to the organization and functioning of risk management systems in banks are considered. Approaches to the analysis of the bank’s solvency and capital adequacy are considered; approach to the analysis of a bank’s credit risk; approach to the analysis of the risk of loss of bank liquidity; approach to the analysis of a bank’s market risk; the approach to the analysis of the bank’s currency risk is considered. The use of the approach to determining the market share of the bank, the BCG matrix by the indicators of total income / loss is reasoned. The level of concentration of the banking market is analyzed and general problems of the banking sector development are identified. The level of influence of the leading banks in the banking market is proved and the dependence between the indicators of the balance sheet currency of Ukrainian banks is substantiated. The process of forming an information base for determining the financial condition of the bank is determined. The main results of the study are the development of practical recommendations for organizing the process of diagnosing the financial condition of the bank and the creation of a methodology for determining the financial condition of the bank by determining the indicator of the probability of bank default by researching the banking market, clustering banks and determining the risk of default of a particular bank based on the analysis of the quality of the bank’s net cash flow, financial condition of Ukrainian banks. The general algorithm for diagnosing the financial condition of the bank based on stress testing is clarified. The method for determining the probability of a bank’s default is clarified, based on the clustering of the aggregate of banks by determining the dynamics of the share of a particular bank in the banking services market, the composition of the elements of the net cash flow from the operating, investment and financial activities of the bank based on the financial statements of Ukrainian banks, the index of the influence of a particular bank on the local market.

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. Самородов Борис Вадимович
2. Samorodov Borys V.

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. Житар Максим Олегович
2. Zhytar Maksym O.

Кваліфікація: к. 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. Коваленко Вікторія Володимирівна
2. Kovalenko Viktoriia Volodymyrivna

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

Рецензенти

VIII. Заключні відомості

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові
голови ради**

Барановський Олександр Іванович

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

Барановський Олександр Іванович

**Відповідальний за підготовку
облікових документів**

Реєстратор

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



Юрченко Т.А.