Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0421U101683

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 17-05-2021

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Панченко Катерина Сергіївна
2. Panchenko Kateryna S.

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: 26-04-2021

Спеціальність за освітою: Економічна кібернетика

Місце роботи здобувача: АКЦІОНЕРНЕ ТОВАРИСТВО "РАЙФФАЙЗЕН БАНК АВАЛЬ"

Код за ЄДРПОУ: 14305909

Місцезнаходження: вул. Лєскова, 9, м. Київ, 01011, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Національний банк України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д 26.006.07

Повне найменування юридичної особи: Державний вищий навчальний заклад "Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана"

Код за ЄДРПОУ: 02070884

Місцезнаходження: проспект Перемоги, буд. 54/1, м. Київ, 03057, 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: Державний вищий навчальний заклад "Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана"

Код за ЄДРПОУ: 02070884

Місцезнаходження: проспект Перемоги, буд. 54/1, м. Київ, 03057, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 28.29.15

Тема дисертації:

1. Управління ринковим ризиком комерційного банку

2. Market Risk Management of Commercial Bank

Реферат/анотація:

1. У дисертації розроблено концептуальні підходи та відповідні економіко-математичні моделі оцінювання ринкового ризику комерційного банку для підвищення якості управління ризиками комерційного банку. Запропоновані у дослідженні підходи до управління ринкового ризику передбачають використання стрес-тестування, що дозволяє найбільш повно оцінити ризик в умовах нестабільної економічної ситуації, а також управляти ризиком в період економічного зростання шляхом виявлення потенційних загроз банківського сектору та завчасної розробки системи запобіжних заходів для уникнення непередбачуваних втрат. Розроблені підходи щодо оцінювання ринкового ризику комерційного банку передбачають три ключові елементи: вибір змінних, які найбільше характеризують ринковий ризик, збір та обробка даних для формування часових рядів; побудова моделі векторної авторегресії, яка включає наявні та потенційні зв'язки між змінними; побудова сценаріїв стрес-тестування ринкового ризику на основі функцій імпульсних відгуків.

На основі оцінених моделей векторної авторегресії розроблено математичні моделі сценаріїв стрес-тестування ринкового ризику із застосуванням функцій імпульсних відгуків, які враховують багатовимірність ринкового ризику. Розроблені сценарії використано для оцінювання впливу реалізації шокового сценарію змін ринкових та макроекономічних показників на фінансовий стан банку на прикладі окремих комерційних банків України.

2. The dissertation is devoted to develop conceptual approaches and appropriate economic and mathematical models for assessing the market risk of a commercial bank to improve the quality of risk management of a commercial bank. The paper proposes to investigate approaches to market risk management using stress testing methods, due to the fact that stress testing of bank risks, including market risks, is a mandatory regulatory requirement, allows the most complete and adequate assessment of risk in an unstable economic situation, as well as more efficient and balanced risk management during the period of economic growth by identifying potential threats to the banking sector and developing a system of measures in advance to prevent catastrophic losses. New scientific results are the development of the concept of market risk stress testing of a commercial bank, based on econometric modeling methods, which contain three key elements: selection of variables that most characterize market risk, collection and processing of data to form time series; building an econometric model that includes existing and potential relationships between variables; construction of scenarios for stress testing of market risk. When implementing the developed conceptual provisions for assessing market risk based on econometric models, the use of vector autoregression models is justified, which allow taking into account information about the relationship between financial and macroeconomic indicators, and also have tools for analyzing the behavior of the system over a long period of time. The developed models are used to assess the impact of the implementation of the shock scenario of changes in market and macroeconomic indicators on the financial condition on the example of individual commercial banks of Ukraine by determining the effect of the implementation of certain types of banking risks.

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. Піскунова Олена Валеріївна

2. Piskunova Olena V.

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. Дадашова Первін Акіфівна
2. Dadashova Pervin A.

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

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Мінц Олексій Юрійович
2. Mints Oleksii Yu.

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

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Великоіваненко Галина Іванівна

2. Velykoivanenko Halyna I.

Кваліфікація: к.ф.-м.н., 01.01.05

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. Бараник Зоя Павлівна

2. Baranyk Zoya P.

Кваліфікація: д. е. н., 08.00.10

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

VIII. Заключні відомості

Власне Прізвище Ім'я По-батькові голови ради Матвійчук Андрій Вікторович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Матвійчук Андрій Вікторович

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Т.А.