

Облікова картка НДДКР

Державний обліковий номер: 0215U000018

Державний реєстраційний номер: 0113U000507

Відкрита

Дата реєстрації: 14-01-2015



1. Етапи виконання

Номер етапу: 1

Назва етапу: Формування інтегрованої системи управління ризиками банку в умовах високої волатильності ринків

Початок етапу: 01-2013

Закінчення етапу: 12-2014

Вид звітнього документа: Остаточний звіт

2. Виконавець

Назва організації: Київський національний торговельно-економічний університет

Код ЄДРПОУ/ІПН: 01566117

Підпорядкованість: Міністерство освіти і науки, молоді та спорту України

Адреса: 02156, м. Київ, вул. Кіото, 19

Телефон: (044) 544-74-14

E-mail: knteu@knteu.kiev.ua

WWW: www.knteu.kiev.ua

3. Власник результатів НДДКР (продукції)

Назва організації: Інститут енергозбереження та енергоменеджменту Національного технічного університету України "Київський Політехнічний Інститут"

Код ЄДРПОУ/ІПН: 00027677

Адреса: пр. Перемоги 37, м. Київ, Київ, 03056, Україна

Підпорядкованість: Міністерство освіти і науки України

Телефон: 0442048428

E-mail: auek@ukr.net

4. Джерела та напрями фінансування

Підстава для проведення робіт: 34 - договір (замовлення) з центральним органом виконавчої влади, академією наук (головними розпорядниками бюджетних коштів на проведення НДДКР)

КПКВК: 2201040

Напрямок фінансування: 2.2 - прикладні дослідження і розробки

Джерела фінансування

Джерело фінансування: 7713 – кошти держбюджету

Фактичний обсяг фінансування за звітний етап: 345.7 тис. грн.

5. Науково-технічна робота

Назва роботи (укр)

Формування інтегрованої системи управління ризиками банку в умовах високої волатильності

Назва роботи (англ)

Formation of an integrated system of risk management under conditions of high market volatility

Реферат (укр)

Об'єктом дослідження виступає процес формування інтегрованої системи управління ризиками в банках України. Метою науково-дослідної роботи є розробка теоретико-методологічних положень та практичних рекомендацій щодо побудови інтегрованої системи управління ризиками банку при зростанні рівня волатильності ринків. Найсуттєвішими теоретичними та практичними результатами роботи є: обґрунтування наукових гіпотез щодо впливу глобальних дисбалансів на рівень кредитного ризику банків та пропозицій стосовно управління ним в умовах високої волатильності ринків; визначення агрегованої величини ризику банку з урахуванням зон інтересів зацікавлених сторін та їх узгодження у контексті достатності банківського капіталу; забезпечення транспарентності інформації щодо діяльності банків в цілому та ризиків, зокрема в контексті зміцнення їх ринкової дисципліни; розробка матриці ризиків, виходячи з різних цілей менеджменту; методичні положення діагностики стану управління ризиками банку, включаючи розробку анкети оцінки стану ризик-менеджменту; побудова інтегрованої системи управління ризиками (ICYP), визначення її ключових особливостей та елементів; формування інфраструктури ризик-менеджменту, адекватної новій парадигмі ризик-орієнтованого управління банком; оцінка результативності ICYP.

Реферат (англ)

The object of research is the process of forming the integrated system of risk management in banks of Ukraine. The aim of the research is to develop a theoretical and methodological guidelines and practical recommendations for the forming of the integrated risk management system of the bank in conditions of market volatility increase. The most important theoretical and practical results of the work are: justification of scientific hypotheses about the impact of global imbalances on the level of credit risk in banks and proposals for the credit risk-management in conditions of high market volatility; determination of the aggregate value of the bank's risk taking into account the areas of stakeholder interests and their agreement in the context of bank capital adequacy; ensuring transparency of information about the activities of banks and in particular risks in the context of strengthening their market discipline; developing a risk matrix based on various management purposes; methodical guidelines for diagnosis of the condition of the bank risk management, including the development of the questionnaire assessment of risk management; the forming of the integrated risk management system (IRMS), definition of its key features and elements; formation of an infrastructure of risk management, that is adequate to new paradigm of risk-based management of the bank; evaluating the performance of IRMS.5481

Індекс УДК: 336.71, 336.71:338.51

Коди тематичних рубрик НТІ: 06.73.55

6. Науково-технічна продукція (НТП)

НТП 1

Назва продукції (укр): Теоретико-методологічні та методичні засади формування інтегрованої системи управління ризиками в банках України в умовах високої волатильності ринків.

Назва продукції (англ): Theoretical, methodological and methodical bases of formation of integrated risk management in banks of Ukraine in conditions of high market volatility.

Очікувані результати: методична документація, нормативно-технічна документація, правові документи

Галузь застосування: Освіта. Управління підприємствами. Фінансова та страхова діяльність

Опис продукції (укр): Теоретико-методологічні та методичні засади ІСУР включають концепцію ІСУР та етапи її впровадження в практику банків України; рекомендації щодо побудови інфраструктури управління ризиками; обґрунтування пропозицій щодо розвитку мега-, макро- та мікро-регулювання кредитного ризику банків, настання якого призвело до найбільших збитків під час світової фінансової кризи. Розроблені пропозиції базуються на інноваційних авторських підходах, узагальненні передової зарубіжної банківської практики та нових стандартах Базельського комітету.

Соціально-економічна спрямованість НТП:

Стадія завершеності НТП: Звіт по НДДКР

Впровадження НТП: Впроваджено

Строки впровадження: 2013-2014 рр.

Виробник продукції: Київський національний торговельно-економічний університет

Споживачі продукції: Національний банк України, Асоціація "Український Кредитно-Банківський Союз" банки України

Перспективні ринки: Ринок фінансових послуг України

Права інтелектуальної власності: монографія

Форми та умови передачі продукції: Продаж продукції

7. Бібліографічний опис

8. Звітна документація

Кількість сторінок в звіті: 504

Мова звіту: Українська

Кількість файлів у звіті: 1

9. Заключні відомості

Перелік осіб-виконавців

Белякова В. П.

Бріло Є. В.

Броді Н. І.

Бусько К. А.

Глибокий В. М.

Гордієнко Т. М.

Гурський Д. Ю.

Еркес О.Є.

Кіреева К. О.

Маслова Н.О.

Мельниченко О. В.

Мельничук М. В.

Мотузінський В. Ю.

Нетребчук Л. О.

Опанасюк Ю.І.

Поправка О. Г.

Провотар В. А.

Сидоренко В.А.

Степашова А. І.

Фуксман О. Ю.

Храменко О. С.

Христенко М. Л.

Шаперенков А.В.

Шаповал О. Ю.

Шпаковська О. Л.

Шульга Н.П.

Керівник організації:

Мазаракі Анатолій Антонович (д. е. н., професор)

Керівники роботи:

Шульга Наталія Петрівна (д. е. н., професор)

**Керівник відділу реєстрації наукової діяльності
УкрІНТЕІ**



Юрченко Т.А.