

РЕФЕРАТ

кваліфікаційної роботи магістра

студента Національної академії статистики, обліку та аудиту

Семенюка Юрія Дмитровича

Тема "Модель оцінки фінансової безпеки банку"

Загальний обсяг роботи складає 87 сторінок.

Містить 17 таблиць, 20 рисунків. 47 використаних джерел.

Актуальність дослідження обумовлена тим, що проблема оцінювання фінансової безпеки банку є однією з ключових для української економіки. Глобальні фінансові кризи, непроста економічна ситуація в країні призводять до стрімкого зростання кількості збанкрутілих та ліквідованих банківських організацій. Тому пошук шляхів вирішення проблеми, вивчення підходів і методів фінансової діагностики фінансової безпеки залишаються актуальними задачами.

Мета кваліфікаційної роботи полягає в побудові моделі для оцінювання рівня фінансової безпеки підприємства.

Об'єкт дослідження – процеси аналізу фінансового стану банківських організацій та оцінювання їх фінансової безпеки.

Предмет дослідження – моделі оцінювання фінансової безпеки банківської організації.

Методами дослідження виступають аналіз літературних джерел, системний аналіз, метод теоретичного узагальнення, методи теорії нечітких множин.

Основний науковий результат полягає в:

- визначенні показників для оцінювання фінансової безпеки підприємства;
- розробці функцій приналежності для визначення ступеня впевненості в приналежності значення нечіткій множині.

Одержані результати можуть бути використані в діяльності управлінського персоналу банку.

У розділі 1 описано поняття економічної та фінансової безпеки банківської системи та банку, визначено їх співвідношення. Для фінансової безпеки наведені її характеристики. Визначені та проаналізовані сучасні методи та моделі оцінювання фінансової безпеки

Розділ 2 містить аналіз показників, що характеризують фінансову діяльність банків. Проведений аналіз підходів до моделювання невизначеності для економічних об'єктів. Побудована модель оцінювання фінансової безпеки на основі теорії нечітких множин.

Розділ 3 присвячено опису модельних розрахунків. Розроблена комп'ютерна реалізація запропонованої моделі. Проведене дослідження отриманої моделі. Побудовані оцінки фінансової безпеки банку.

Ключові слова: ФІНАНСОВА БЕЗПЕКА, БАНКІВСЬКА ОРГАНІЗАЦІЯ, ТЕОРІЯ НЕЧІТКИХ МНОЖИН, ФІНАНСОВА СТІЙКІСТЬ, ПОКАЗНИКИ ФІНАНСОВОЇ ДІЯЛЬНОСТІ БАНКУ.

Рік виконання 2020. Рік захисту 2021.