

РЕФЕРАТ

Дипломна робота: 135с., 25 рис., 20 табл., 2 додатки, 33 джерела.

Об'єкт дослідження – ліквідність та ризик ліквідності комерційного банку.

Предмет дослідження – методики стрес-тестування.

Мета роботи створити інформаційно-аналітичну систему для моделювання, прогнозування та стрес-тестування показників ліквідності.

В роботі проведено аналіз динаміки ліквідності обраного комерційного банку, проаналізовано існуючі методики стрес-тестування, визначено індивідуальні особливості обраного комерційного банку, підібрано спеціалізовану методику стрес-тестування та реалізовано цю методику у вигляді інформаційно-аналітичної системи. Розроблений програмний продукт дозволяє аналізувати, прогнозувати та проводити стрес-тестування показника ліквідності.

Система реалізована на мові програмування Matlab, у середовищі розробки MatLab 2015. Інтерфейс користувача створений за допомогою середовища розробки графічного інтерфейсу GUIDE. Наведено приклади застосування програми для прогнозування та стрес-тестування показника ліквідності на реальних фінансових даних. Розглянуто шляхи можливого подальшого вдосконалення системи.

ЛІКВІДНІСТЬ, СТРЕС-ТЕСТУВАННЯ, АНАЛІЗ ЧУТЛИВОСТІ, СЦЕНАРНИЙ АНАЛІЗ, ЗВОРОТНІЙ АНАЛІЗ, АВТОРЕГРЕСІЯ.