

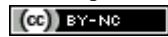
Алаа М. Солиман, Адам Мухтар, Моаде Ф. Шубита

Аналіз довгострокового зв'язку між управлінням ризиками підприємства та результатами банківської діяльності: відсутня ланка в Нігерії

У статті проаналізовано зв'язок між запровадженням та здійсненням управління ризиками підприємства та результатами діяльності банків на основі вибірки чотирьох з семи стратегічно важливих банків, що мають лістинг акцій на Нігерійській фондовій біржі за період з 2005 q1 до 2015 q2. Автори статті визначають показник ефективності запровадження чи здійснення управління ризиками підприємства (індекс управління ризиками підприємства) за допомогою інтегрованої моделі оцінки управління ризиками підприємства для банківського сектору, запропонованої Солиманом та Мухтаром (2017). Для отримання доказів довгострокового зв'язку між управлінням ризиками підприємства та результатами діяльності був використаний тест Йохансена на коінтеграцію часових рядів, в той час як для збору доказів причинно-наслідкового зв'язку між управлінням ризиками підприємства та результатами діяльності була використана векторна модель корекції похибок. Наостанок, для отримання доказів впливу управління ризиками підприємства на імпульсну реакцію на результати діяльності була використана функція генералізованої імпульсної реакції. Стаття робить значний внесок у сучасну літературу, так як надає перші емпіричні докази зв'язку між управлінням ризиками підприємства та результатами діяльності, що вказують на довгостроковий зв'язок, причинно-наслідковий зв'язок, а також реакцію на результати управління ризиками підприємства.

Ключові слова: управління ризиками підприємства, банківський сектор Нігерії, результати діяльності компаній, довгостроковий зв'язок, причинно-наслідковий зв'язок, імпульсна реакція.

Класифікація JEL: G21, G31, G32.



Стаття знаходиться у відкритому доступі і може розповсюджуватися на умовах ліцензії [Creative Commons Attribution-NonCommercial 4.0 International](https://creativecommons.org/licenses/by-nc/4.0/) license, що дозволяє повторне використання, розповсюдження та відтворення, забороняє використання матеріалів у комерційних цілях та вимагає наявності відповідного посилання на оригінальну версію статті.

Алаа М. Солиман, Адам Мухтар, Моаде Ф. Шубита

Анализ долгосрочной связи между управлением рисками предприятия и результатами банковской деятельности: недостающее звено в Нигерии

В статье проанализирована связь между внедрением и осуществлением управления рисками предприятия и результатами деятельности банков на основе выборки четырех из семи стратегически важных банков, имеющих листинг акций на Нигерийской фондовой бирже за период с 2005 q1 по 2015 q2. Авторы статьи определяют показатель эффективности внедрения или осуществления управления рисками предприятия (индекс управления рисками предприятия) при помощи интегрированной модели оценки управления рисками предприятия для банковского сектора, предложенной Солиманом и Мухтаром (2017). Для получения доказательств долгосрочной связи между управлением рисками предприятия и результатами деятельности был использован тест Йохансена на коинтеграцию временных рядов, в то время как для сбора доказательств причинно-следственной связи между управлением рисками предприятия и результатами деятельности была использована векторная модель коррекции ошибок. Напоследок, для получения доказательств влияния управления рисками предприятия на импульсную реакцию на результаты деятельности была использована функция генерализированной импульсной реакции. Статья делает значительный вклад в современную литературу, так как дает первые эмпирические доказательства связи между управлением рисками предприятия и результатами деятельности, указывающие на долгосрочную связь, причинно-следственную связь, а также реакцию на результаты управления рисками предприятия.

Ключевые слова: управление рисками предприятия, банковский сектор Нигерии, результаты деятельности компаний, долгосрочная связь, причинно-следственная связь, импульсная реакция.

Классификация JEL: G21, G31, G32.



Статья находится в открытом доступе и может распространяться на условиях лицензии [Creative Commons Attribution-NonCommercial 4.0 International](https://creativecommons.org/licenses/by-nc/4.0/) license, что позволяет повторное использование, распространение и воспроизведение, запрещает использование материалов в коммерческих целях и требует наличия соответствующей ссылки на оригинальную версию статьи.