Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0405U000753

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 02-03-2005

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Коваленко Юлія Михайлівна
2. Kovalenko Yulia Mikhailivna

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: так

Шифр наукової спеціальності: 08.04.01

Назва наукової спеціальності: Фінанси, грошовий обіг і кредит

Галузь / галузі знань: Не застосовується

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 17-02-2005

Спеціальність за освітою: 7.050101

Місце роботи здобувача: Академія державної податкової служби України

Код за ЄДРПОУ: 02973089

Місцезнаходження: 08200, Україна, Київська обл., м.Ірпінь, вул.К.Маркса, 31

Форма власності:

Сфера управління: Державна податкова адміністрація України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д 27.855.01

Повне найменування юридичної особи: Університет державної фіскальної служби України

Код за ЄДРПОУ: 40233365

Місцезнаходження: вул. Університетська, 31, м. Ірпінь, Київська обл., 08205, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Державна фіскальна служба України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

IV. Відомості про підприємство, установу, організацію, в якій було виконано дисертацію

Повне найменування юридичної особи: Академія державної податкової служби України

Код за ЄДРПОУ: 02973089

Місцезнаходження: 08200, Україна, Київська обл., м.Ірпінь, вул.К.Маркса, 31

Форма власності:

Сфера управління: Державна податкова адміністрація України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.71.25

Тема дисертації:

1. Управління фінансовими інвестиціями

2. Financial investments administration

Реферат/анотація:

1. Об'єкт дослідження. Інвестиційні відносини у фінансовому секторі економіки. Мета дослідження. Розробка теоретико-методичного забезпечення управління фінансовими інвестиціями, спрямованого на розширення ролі цих інвестицій у діяльності інституційних інвесторів. Методи дослідження: діалектичний, графічний, аналізу та синтезу, статистичні та економіко-математичні методи, системний і порівняльний аналіз. Теоретичні і практичні результати. Сформульовані та обґрунтовані наукові положення, висновки та рекомендації збагачують теорію і практику управління фінансовими інвестиціями, мають значну практичну цінність для визначення цілей інституційного інвестора, формування його стратегії і тактики на фінансовому ринку, моніторингу портфеля фінансових інвестицій. Новітність нововпроваджуваного. Одержано такі найважливіші результати, які визначають внесок у розробку проблеми та характеризують наукову новизну роботи: вперше доведено тотожність інструментів фінансового інвестування та фінансового ринку, обґрунтовано авторське тлумачення терміну "фінансовий інструментарій", запропоновано багаторівневу схему розміщення активів інституційних інвесторів із застосуванням коваріаційного методу оцінки ринкових

ризиків Value-at-Risk (VaR); удосконалено: визначення категорії "фінансові інвестиції"; методичні підходи до сегментації фінансового ринку; алгоритм процесу управління фінансовими інвестиціями інституційних інвесторів загалом і з урахуванням особливостей діяльності кожного інституту; отримали подальший розвиток система фінансового інструментарію для інституційних інвесторів і напрями активізації фінансового інвестування в Україні. Ступінь упровадження. Основні висновки за результатами дослідження використані Державною комісією з регулювання ринків фінансових послуг України (довідка № 20/814 від 12.02.04), Державною комісією з цінних паперів та фондового ринку (довідка № 27/7061 від 03.06.04), АТ "Укрінбанк" (довідка № 01/1228 від 28.05.04), а також у навчальному процесі Національної академії державної податкової служби України (довідка № 1612/01-12 від 27.05.04) та Київського національного економічного університету (довідка від 06.04.04). Сфера використання. Управління фінансовими інвестиціями інституційних інвесторів.

2. Research object. Investment relations in the financial sector of economy. Research purpose. Working out a theoretical and practical provision of financial investments administration that is aimed on expansion of the role of these investments in the institutional investors' activity. Research methods: dialectical, graphic, analysis and synthesis, statistical, economic and mathematical methods, system and comparative analysis. Theoretical and practical results. Well-founded scientific principles, conclusions and recommendations made improve the theory and practice of financial investments administration, have sufficient practical value for working out the investor's purposes, his strategy and tactics in the financial market, monitoring of financial investments portfolio. Novelty of the innovation. The important results have been got that show the contribution to problem elaboration and scientific novelty of the thesis: identity of the instruments of financial investment and financial market is proved forthe first time; author's interpretation of the notion "financial instruments" is motivated; multileveled scheme of institutional investors' assets allocation is proposed using the covariation method of market risks estimation Value-at-Risk (VaR); there improved: definition of the notion "financial investments"; methodical approaches to segmentation of financial market; algorithm of process of financial investments administration of institutional investors in general and including the peculiarities of each institute activity; there is worked out the system of financial instruments for institutional investors and the directions of financial investment activation in Ukraine. Level of adoption. Main conclusions based on the research results are used by the State commission on regulation of financial services markets of Ukraine (reference №20/814 of 12.02.04), State commission on securities and stock market (reference №27/7061 of 03.06.04), JSC "Ukrinbank" (reference №01/1228 of 28.05.04), in education process ofthe National Academy of State Tax Service of Ukraine (reference №1612/01-12 of 27.05.04) and Kyiv National University of Economics (reference of 06.04.04). Sphere of usage. Administration of institutional investors' financial investments.

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. Пересада А.А.

2. Peresada A.A.

Кваліфікація: д.е.н., 08.04.01

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. Мороз А.М.

2. Мороз А.М.

Кваліфікація: д.е.н., 08.04.01

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. Луців Б.Л.

2. Луців Б.Л.

Кваліфікація: к.е.н., 08.04.01

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Рецензенти

VIII. Заключні відомості

Власне Прізвище Ім'я По-батькові голови ради Мельник П.В.

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Мельник П.В.

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності Юрченко Т.А.