Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0821U102671

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 29-11-2021

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Пивоварова Ганна Борисівна
2. Pyvovarova Hanna B.

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCHID ID: Не застосовується

Вид дисертації: доктор філософії

Аспірантура/Докторантура: так

Шифр наукової спеціальності: 051

Назва наукової спеціальності: Соціальні та поведінкові науки. Економіка

Галузь / галузі знань:

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 18-11-2021

Спеціальність за освітою: Економіст

Місце роботи здобувача: Товариство з обмеженою відповідальністю "Будівельна лабораторія"

Код за ЄДРПОУ: 31292226

Місцезнаходження: вул. Богдана Хмельницького, 14А, м. Дніпро, Дніпровський р-н., Дніпропетровська обл., 49051, Україна

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Сектор науки: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): ДФ 08.820.008

Повне найменування юридичної особи: Український державний університет науки і технологій

Код за ЄДРПОУ: 44165850

Місцезнаходження: вул. Лазаряна, 2, м. Дніпро, Дніпровський р-н., Дніпропетровська обл., 49010, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Сектор науки: Не застосовується

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

Повне найменування юридичної особи: Дніпровський національний університет залізничного транспорту імені академіка В. Лазаряна

Код за ЄДРПОУ: 01116130

Місцезнаходження: вул. Лазаряна, буд. 2, м. Дніпро, Дніпровський р-н., Дніпропетровська обл., 49010, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Сектор науки: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 73.29.75

Тема дисертації:

1. УПРАВЛІННЯ ЕКОНОМІЧНИМИ РИЗИКАМИ В УМОВАХ ФІНАНСОВОЇ НЕСТАБІЛЬНОСТІ (НА ПРИКЛАДІ ПІДПРИЄМСТВА ЗАЛІЗНИЧНОГО ТРАНСПОРТУ)

2. MANAGEMENT OF ECONOMIC RISKS IN CONDITIONS OF FINANCIAL INSTABILITY (ON THE EXAMPLE OF THE RAILWAY TRANSPORT ENTERPRISE)

Реферат:

1. Пивоварова Г.Б. Управління економічними ризиками в умовах фінансової нестабільності (на прикладі підприємства залізничного транспорту). – Кваліфікаційна наукова праця на правах рукопису. Дисертація на здобуття наукового ступеня доктора філософії за спеціальністю 051–Економіка. – Дніпровський національний університет залізничного транспорту імені академіка В. Лазаряна, Дніпро, 2021. Метою

дисертаційного дослідження є теоретико-методичне обґрунтування та розробка практичних рекомендацій щодо управління економічними ризиками в умовах фінансової нестабільності. Наукова новизна одержаних результатів полягає у обґрунтуванні та подальшому розвитку науково-методичних підходів і практичних рекомендацій щодо управління економічними ризиками в умовах фінансової нестабільності. Розроблені у процесі дослідження важливі наукові положення, що визначають наукову новизну дисертаційної роботи, полягають у наступному: удосконалено: - науково-методичні підходи до прийняття інвестиційних рішень в умовах ризику щодо боргових і пайових цінних паперів, а також проектів реального інвестування, які на відміну від існуючих, враховують відмінності критеріїв економічної ефективності в умовах ризику боргових фінансових інструментів з одного боку та пайових інструментів і реальних інвестиційних проектів з іншого, однозначно встановлюють зв'язок ставки дисконту з урахуванням премії за ризик та закону розподілу грошових потоків для боргових фінансових інструментів, визначають критерії економічної ефективності інвестицій в умовах ризику на базі множини можливих сценаріїв з урахуванням зв'язку рівнів дохідності та ризику, який виявляється на фінансовому рику, що дозволяє узгодити підходи до прийняття рішень в умовах ризику на базі одного та множини сценаріїв; - науково-методичні підходи до моделювання законів розподілу показників очікуваної ефективності інвестицій в умовах невизначеності за допомогою методу статистичних випробувань, що на відміну від існуючих, передбачаються застосування баготокутних, у тому числі трикутних, законів розподілу факторних показників імітаційних моделей, що дозволяє адекватно відобразити відому про них інформацію; набули подальшого розвитку: - економіко-математичні моделі грошових потоків інвестиційного проекту в умовах ризику, у тому числі у сфері залізничного транспорту, які на відміну від існуючих, дозволяють формувати імітаційну модель інвестиційного проекту для застосування методу статистичних випробувань, що дозволяє зменшити рівень невизначеності та формулювати задачу прийняття інвестиційного рішення для умов ризику; - підходи до прогнозування грошових потоків інвестиційного проекту в сфері залізничного транспорту, які на відміну від існуючих враховують взаємозв'язок факторних показників імітаційної моделі, а також інтервали їх можливих коливань, що дозволяє використовувати результати прогнозування у процедурах статистичних випробувань. Практичне значення одержаних результатів полягає у використанні результатів дослідження у практичній діяльності відокремлених структурних підрозділів АТ «Укрзалізниця» (довідка від 18.03.2021 № 87-в), а також у навчальному процесі при підготовці бакалаврів та магістрів (довідка від 13.04.2021 № НДЧ-48/97). Практичну цінність мають результати дослідження стану залізничного транспорту з точки зору управління ризиками і зв'язку рівня ризику та дохідності на фінансовому ринку та отримана при цьому модель залежності норми доходу від рівня ризику, виміряного як стандартне відхилянні дохідності. Ключові слова: ризик, невизначеність, ставка дисконту, закон розподілу грошового потоку, очікувана ефективність, премія за ризик, норма доходу, векторна оптимізація, метод статистичних випробувань. Список публікацій здобувача: 1. Пивоварова Г.Б. Хеджування валютних ризиків кредитного портфеля АТ «Укрзалізниця». Ефективна економіка. 2019. №12. 2. Бобиль В.В., Пивоварова Г.Б. Класифікація економічних ризиків залізничного транспорту України. Ефективна економіка. 2020. №12. 3. Бобиль В.В., Гненний О.М., Пивоварова Г.Б. До питання оцінки ефективності інвестицій в умовах ризику. Ефективна економіка. 2021. №4. 4. Бобиль В.В., Гненний О.М., Пивоварова Г.Б. Оцінка ефективності інвестицій в умовах ризику з урахуванням звпязку рівнів дохідності та ризику. Ефективна економіка. 2021. №6. 5. Pyvovarova Hanna. Analysis of the main indicators of the enterprise JSC "Ukrzaliznytsia" 2010-2019. Regional Revue. no. 1, vol. 1/2021. S 4-8.

2. Pyvovarova H.B. Management of economic risks in conditions of financial instability (on the example of the railway transport enterprise). - Qualification scientific work on the rights of manuscript. Dissertation for the academic degree of Doctor of Philosophy in the specialty 051-Economics. - Dnipro National University of Railway Transport named after Academician V. Lazaryan, Dnipro, 2021. The purpose of the dissertation research is the theoretical and methodological substantiation and development of practical recommendations concerning the management of economic risks in conditions of financial instability. Scientific and methodological approaches to making investment decisions under conditions of risk with respect to debt and equity securities, as well as real investment projects have been developed. Improved the scientific and methodological approaches to modeling the

laws of distribution of indicators of expected effectiveness of investment under conditions of uncertainty simulation of investment project. Developed economic-mathematical models of cash flows of the investment project in conditions of risk, including in the field of railway transport. The state of railway transport in terms of risk management has been analyzed. The relationship between the level of risk and profitability in the financial market has been investigated. Using the developed methodological approaches, taking into account the factors of uncertainty and risk, the assessment of the economic efficiency of the investment project in the field of railroad transport has been performed. The scientific novelty of the results obtained consists in the substantiation and further development of scientific and methodological approaches and practical recommendations concerning the management of economic risks in conditions of financial instability. Developed in the process of research important scientific provisions that define the scientific novelty of the dissertation work are as follows: improved: ▫ scientific and methodical approaches to making investment decisions under conditions of risk regarding debt and equity securities, as well as real investment projects, which, unlike existing ones, take into account the differences in economic efficiency criteria under conditions of risk of debt financial instruments on the one hand and equity instruments and real investment projects on the other hand, uniquely establish a relationship of discount rate with regard to risk premium and the law of distribution of cash flows for debt financial instruments, determine the criteria of economic efficiency of investments at risk on the basis of a set of possible scenarios, taking into account the connection between the levels of return and risk, which is found in the financial market, which allows to coordinate approaches before making decisions under the risk on the basis of one and a set of scenarios; ▫ scientific and methodological approaches to modeling the laws of distribution of indicators of expected effectiveness of investment under uncertainty using the method of statistical tests, which, in contrast to existing ones, involve the use of polygonal, including triangular, distribution laws of factor indicators of simulation models, which allows to adequately reflect the known information about them; have been further developed: ▫ economic-mathematical models of cash flows of the investment project under conditions of risk, including railway transport, which, in contrast to existing ones, allow to form a simulation model of the investment project to apply the method of statistical tests, which reduces the level of uncertainty and formulate the problem of making an investment decision for risk conditions; ▫ approaches to the forecasting of cash flows of an investment project in the field of railway transport, which, in contrast to existing ones, take into account the relationship of factor indicators of the simulation model, as well as intervals of their possible fluctuations, which allows the use of forecasting results in the procedures of statistical tests. The practical significance of the obtained results is the use of research results for the practical work of the divisions of JSC "Ukrzaliznytsia" (certificate dd 18.03.2021 87-b), as well as in the educational process in the training of bachelors and masters (certificate dd 13.04.2021 NDCH - 48/97). Practical value have the results of the research of the state of railway transport in terms of risk management and the relationship of the level of risk and profitability in the financial market and the obtained model of the dependence of the rate of return on the level of risk, measured as the standard deviation of profitability. Key words: risk, uncertainty, discount rate, law of distribution of cash flow, expected efficiency, risk premium, rate of return, vector optimization, method of statistical tests.

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. Бобиль Володимир Володимирович
2. Bobyl Volodymyr V.

Кваліфікація: 08.00.08

Ідентифікатор ORCHID ID: Не застосовується

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Сектор науки: Не застосовується

VII. Відомості про офіційних опонентів та рецензентів

Офіційні опоненти

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Дикань Олена Володимирівна
2. Dikan Olena V.

Кваліфікація: 08.00.04

Ідентифікатор ORCHID ID: Не застосовується

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Сектор науки: Не застосовується

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Павлов Роман Анатолійович
2. Pavlov Roman A.

Кваліфікація: 08.00.08

Ідентифікатор ORCHID ID: Не застосовується

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Сектор науки: Не застосовується

Рецензенти

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Марценюк Лариса Володимирівна
2. Martseniuk Larysa Volodymyrivna

Кваліфікація: 08.00.04

Ідентифікатор ORCHID ID: Не застосовується

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Сектор науки: Не застосовується

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Матусевич Олексій Олександрович
2. Matusevich Aleksey O.

Кваліфікація: 08.00.04

Ідентифікатор ORCHID ID: Не застосовується

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Сектор науки: Не застосовується

VIII. Заключні відомості

Власне Прізвище Ім'я По-батькові голови ради	Рекун Іван Іванович
Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні	Рекун Іван Іванович
Відповідальний за підготовку облікових документів	
Реєстратор	

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності

Юрченко Т.А.