Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0413U000569

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 28-02-2013

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Слуцька Ольга Володимирівна

2. Slutska Olga Volodymyrivna

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: так

Шифр наукової спеціальності: 08.00.08

Назва наукової спеціальності: Гроші, фінанси і кредит

Галузь / галузі знань: Не застосовується

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 07-02-2013

Спеціальність за освітою: 8.050104

Місце роботи здобувача: Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця

Код за ЄДРПОУ: 02071211

Місцезнаходження: 61166, м. Харків, проспект Науки, 9 а

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): К 64.055.02

Повне найменування юридичної особи:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

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

Повне найменування юридичної особи: Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця

Код за ЄДРПОУ: 02071211

Місцезнаходження: 61166, м. Харків, проспект Науки, 9 а

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.73.07

Тема дисертації:

1. Оцінювання ризику дефолту емітентів корпоративних облігацій

2. Estimation of corporate bonds issuers default risk

Реферат/анотація:

1. Об’єкт роботи: процес оцінювання ризиків на ринку корпоративних облігацій; мета роботи: розвиток теоретичних положень, розроблення методичних підходів та практичних рекомендацій щодо оцінювання ризику дефолту емітентів корпоративних облігацій при інвестуванні на фондовому ринку; методи дослідження та апаратура: аналіз і синтез, логічне узагальнення, семантичний аналіз, порівняльне співставлення, метод графів, кореляційно-регресійний аналіз, багатовимірний факторний аналіз, метод нечіткої логіки, дерева класифікації, нейронні мережі, ланцюги Маркова; теоретичні і практичні результати: методичний підхід до формування фінансових ковенантів при емісії корпоративних облігацій на фондовому ринку України шляхом обґрунтування набору фінансових показників та встановлення їх критичних значень; методичний підхід до оцінювання ризику дефолту емітентів корпоративних облігацій, який ураховує динаміку фінансових показників: ефективності діяльності позичальника, структури його капіталу, ліквідності та платоспроможності, а також загального стану фінансового ринку, що уможливлює визначення здатності

емітента своєчасно розраховуватися за своїми зобов'язаннями; методичне забезпечення оцінювання фінансового стану емітентів корпоративних облігацій, яке базується на використанні показника операційного грошового потоку на інвестований капітал як джерела розрахунку за борговими зобов'язаннями позичальників; структуризація ризиків інвестування у корпоративні облігації, особливість якої полягає у побудові ієрархії ризиків із виділенням ризику дефолту як ключового; визначення поняття дефолту емітентів корпоративних облігацій, відмінність якого полягає в урахуванні часових критеріїв та подій, настання яких свідчить про дефолт емітента облігацій; шкали та критерії оцінювання показників ефективності діяльності, структури капіталу, ліквідності та платоспроможності емітентів корпоративних облігацій, які ураховують вплив випадкових факторів при оцінюванні поточного фінансового стану завдяки використанню теорії нечіткої логіки, що підвищує обґрунтованість фінансового аналізу діяльності підприємств-позичальників; ступінь упровадження: розробки впроваджені в практичну діяльність Східного територіального управління Національної комісії з цінних паперів та фондового ринку, ТОВ «Компанія з управління активами «Авантаж Капітал Менеджмент», ТОВ «Рюрік», ХНЕУ при викладанні навчальної дисципліни «Фінансовий інжиніринг»; сфера використання: інформаційна підтримка ухвалення рішень при інвестуванні в корпоративні облігації, підготовка випуску й формування проспекту емісії облігацій, визначення кредитних класів та рейтингів емітентів облігацій, навчальний процес.

2. Research object: process of risks estimation on the corporate bonds market; the purpose of the research: development of theoretical positions, methodical approaches and practical recommendations to the estimation of corporate bonds issuers' default risk in the investing process on the stock market; research methods and equipment: analysis and synthesis, logic generalization, semantic analysis, comparative matching, the method of graphs, correlation and regression analysis, multivariate factor analysis, the method of fuzzy logic, classification trees, neural networks, Markov chains; the theoretical and practical results: a methodical approach to modelling the financial covenants of corporate bonds issue on the Ukrainian stock market through substantiation of a set of financial indices and determining their critical values; methodical approach to estimation of corporate bonds issuers' default risk, which takes into account the dynamics of financial indicators such as borrower's efficiency, capital structure, liquidity and solvency, as well as the general condition of the financial market, which makes it possible to determine the issuer's ability to pay for its debt on time; methodical support of financial position estimation of corporate bonds issuers, which is based on the use of indicators such as operating cash flow on investment capital as a source of debt payment; structuring of the corporate bond investment risks, a feature of which is a construction of risks hierarchy and selection of the default risk as key one; the definition of corporate bonds issuer's default, the difference of which is consideration of time criteria and events that are evidence of the bond issuer default; the scales and the criteria for estimation of corporate bonds issuer's efficiency, capital structure, liquidity and solvency, which take into account the effect of random factors in estimation of current financial position by using the theory of fuzzy logic, which increases the validity of financial analysis of the borrowers; subject and extent of implementation: results are introduced in practical activity of the Eastern Territorial Administration of the National Commission on Securities and Stock Market, Assets Management Company «Avantazh Capital Management» LTD, «Rurik» LTD, Kharkov National University of Economics at teaching of discipline «Financial Engineering»; sphere of use: information support for decision-making when investing in corporate bonds, preparation of issue Prospectus, the definition of classes and credit ratings of bond issuers, educational process.

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. Нескородєва Інна Іванівна
2. Neskorodeva Inna Ivanivna

Кваліфікація: к.е.н., 08.00.08

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. Лєонов Сергій Вячеславович
2. Лєонов Сергій Вячеславович

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.08

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. Долінський Леонід Борисович
2. Долінський Леонід Борисович

Кваліфікація: к.е.н., 08.03.02

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	Колодізєв Олег Миколайович
Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні	Колодізєв Олег Миколайович
Відповідальний за підготовку облікових документів	
Реєстратор	
Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності	Юрченко Т.А.