Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0417U002402

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 22-06-2017

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Науменко Клим Владиславович

2. Naumenko Klym Vladyslavovych

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: так

Шифр наукової спеціальності: 08.00.02

Назва наукової спеціальності: Світове господарство і міжнародні економічні відносини

Галузь / галузі знань: Не застосовується

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 30-05-2017

Спеціальність за освітою: 8.04020101

Місце роботи здобувача: ТОВ "Делойт Енд Туш"

Код за ЄДРПОУ: 20043783

Місцезнаходження: м. Київ, вул. Жилянська 48-50А

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): К 35.051.21

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: Одеський національний університет імені І.І.Мечникова

Код за ЄДРПОУ: 02071091

Місцезнаходження: 65082, Одеса, вул. Дворянська, 2

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.51

Тема дисертації:

1. Інститути спільного інвестування в умовах глобальної фінансової нестабільності.

2. Collective Investment Institutions in the Context of Global Financial Instability.

Реферат/анотація:

1. В дисертації проаналізовано теоретичні основи функціонування ІСІ. Також проаналізовано вплив цих теорій на трансформацію практичної діяльності і форм організації ІСІ, особливо в сфері індексного інвестування, встановлена роль індексних стратегій інвестування і можливі наслідки поширення такої інвестиційної стратегії для ІСІ та фондового ринку. Оцінено кількісне взаємовідношення пенсійних систем і ІСІ, досліджено специфічні властивості, особливості організації та розвитку в різних регіонах світу біржових фондів (БФ), класифіковано ризики фінансової стабільності і сформулювано виклики, які ставить перед фінансовим співтовариством розвиток біржових фондів. Також, використовуючи вибірку з 35 біржових фондів, що торгуються на Швейцарській фондовій біржі, і розрахунок оцінки помилок слідування чотирма різними способами, емпірично доведено, що і традиційні і синтетичні БФ мають значні помилки слідування.

2. The thesis analyzes theoretical basis of the CII functioning. It also analyses influence of these theories on the transformation of practices and forms of organization of the CII, especially in the field of index investing, role of index investment strategies and possible consequences of the spread of such an investment strategy for CII and

stock market. The relationship of the pension systems and CII is quantified. The research specify properties of exchange-traded funds, especially organization and development in various regions of the world, classifies risks of financial stability and reveals the challenges posed by ETFs development on financial community. It is also empirically proven, using a sample of 35 equity ETFs traded at the Swiss Stock Exchange and tracking error estimation in four different ways, that both traditional and synthetic ETFs have significant tracking errors.

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. Якубовський Сергій Олексійович
2. Yakubovskyi Serhii Oleksiiovych

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.02

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. Грабинський Ігор Михайлович

2. Грабинський Ігор Михайлович

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.01

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. Дугінець Ганна Володимирівна

2. Дугінець Ганна Володимирівна

Кваліфікація: к.е.н., 08.00.02

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 Присяжнюк Юрій Іванович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Присяжнюк Юрій Іванович

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Т.А.