

Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0516U000279

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 07-04-2016

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:



II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Пластун В'ячеслав Леонідович

2. Plastun Viacheslav Leonidovych

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: доктор наук

Аспірантура/Докторантура: ні

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: 24-03-2016

Спеціальність за освітою: 8.050104

Місце роботи здобувача: Українська академія банківської справи

Код за ЄДРПОУ: 23635020

Місцезнаходження: 40030, Україна, м. Суми, вул. Петропавлівська, 57

Форма власності:

Сфера управління: Національний банк України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д 55.081.01

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: Українська академія банківської справи

Код за ЄДРПОУ: 23635020

Місцезнаходження: 40030, Україна, м. Суми, вул. Петропавлівська, 57

Форма власності:

Сфера управління: Національний банк України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.73.07

Тема дисертації:

1. Методологічні основи діяльності інституційних інвесторів на фондовому ринку
2. Methodological bases of institutional investors' activity in the stock market

Реферат:

1. Дисертація присвячена розробленню теоретико-методологічних засад діяльності ІНСІ як фінансових посередників на ФР з урахуванням специфіки їх взаємного впливу. У роботі досліджено сутність ІНСІ як фінансових посередників; поглиблено систему критеріїв класифікації їх типів; поглиблено методичний інструментарій прогнозування динаміки розвитку ФР; розроблено концептуальні засади взаємообумовленості розвитку ФР та ІНСІ; обґрунтовано методологію виявлення причинно-наслідкових зв'язків між розвитком ФР та ІНСІ; досліджено вплив ІНСІ на стабільність розвитку ФР; сформовано систему критеріїв та обмежень при формуванні інвестиційної стратегії ІНСІ; обґрунтовано методичні засади врахування стадії розвитку економіки при її формуванні; удосконалено критеріальну базу портфельної оптимізації ІНСІ; розроблено модель формування оптимального інвестиційного портфелю ІНСІ з урахуванням впливу екзогенних детермінант їх інвестиційної стратегії; удосконалено методичний інструментарій врахування ліквідності фінансових активів та транзакційних витрат на ФР при управлінні інвестиційним портфелем ІНСІ; розроблено комплекс заходів щодо реформування діяльності ФР та ІНСІ в

Україні; запропоновано методичний підхід до регулювання ФР та ІНСІ в залежності від стадії економічного циклу.

2. This dissertation is devoted to development of theoretical and methodological foundations of the institutional investors (INSI) activities as financial intermediaries in the stock market (SM) with accounting for the specifics of their mutual influence. The essence of INSI as financial intermediaries was investigated. The classification of INSI was extended. Methodological tools to predict the dynamics of the SM were proposed. Conceptual principles of interdependence between INSI and SM were developed. Methodology for identifying causal relationships between development of INSI and SM was justified. The influence of INSI on the stability SM was defined. The system of criteria and limitations in the formation of investment strategy of INSI was formed. The methodical basis which takes into account the stage of economic development in the formation of the investment strategy of INSI was proposed. Criterial basis for portfolio optimization of INSI were improved. The model of investment portfolio optimization accounting for the influence of exogenous determinants of INSI's investment strategy was developed. Methodical tools, which take into account the liquidity of financial assets and transaction costs in SM in portfolio management, were proposed. The complex measures for the SM and INSI reform in Ukraine were developed. The methodical approach to the regulation of the SM and INSI depending on the stage of the economic cycle was proposed.

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 ОПВ:

Впровадження результатів дисертації:

Зв'язок з науковими темами:

VI. Відомості про наукового керівника/керівників (консультанта)

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Леонов Сергій Вячеславович

2. Leonov Sergiy Viacheslavovych

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

VII. Відомості про офіційних опонентів та рецензентів

Офіційні опоненти

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Абакуменко Ольга Вікторівна

2. Абакуменко Ольга Вікторівна

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. Пшик Богдан Іванович

2. Пшик Богдан Іванович

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. Кобушко Ігор Миколайович

2. Кобушко Ігор Миколайович

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

Рецензенти

VIII. Заключні відомості

Власне Прізвище Ім'я По-батькові
голови ради

Костюк Олександр Миколайович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові
головуючого на засіданні

Костюк Олександр Миколайович

Відповідальний за підготовку
облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є
відповідальним за реєстрацію наукової
діяльності



Юрченко Т.А.