Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0414U000956

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 28-04-2014

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Семко Роман Богданович

2. Semko Roman Bogdanovych

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: так

Шифр наукової спеціальності: 08.00.11

Назва наукової спеціальності: Математичні методи, моделі та інформаційні технології в економіці

Галузь / галузі знань: Не застосовується

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 31-03-2014

Спеціальність за освітою: 8.050101

Місце роботи здобувача: Національний університет "Києво-Могилянська академія"

Код за ЄДРПОУ: 16459396

Місцезнаходження: 04655, м. Київ, вул. Г. Сковороди, 2

Форма власності:

Сфера управління: Кабінет міністрів

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д26.006.07

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: Національний університет "Києво-Могилянська академія"

Код за ЄДРПОУ: 16459396

Місцезнаходження: 04655, м. Київ, вул. Г. Сковороди, 2

Форма власності:

Сфера управління: Кабінет міністрів

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.35.51

Тема дисертації:

1. Моделювання монетарних процесів в умовах збурень на фондовому ринку

2. Monetary processes modeling during stock market fluctuations

Реферат/анотація:

1. Дисертацію присвячено дослідженню теоретико-методологічних та емпіричних аспектів монетарних процесів, зокрема моделюванню грошово-кредитної політики з урахуванням коливань на фондовому ринку з метою досягнення макроекономічної та фінансової стабільності. У роботі обґрунтовано концептуальні положення формування оптимальної монетарної політики при виявленні збурень на фондовому ринку з використанням сучасного економіко-математичного інструментарію - розробленої динамічної стохастичної моделі загальної рівноваги для малої відкритої економіки з фінансовим акселератором та фондовою бульбашкою. На основі побудованої та оціненої з допомогою байєсівської економетрики моделі досліджено реакцію економіки України на дію зовнішніх та внутрішніх шоків. Результати аналізу показують, що оптимальним монетарним правилом для Національного банку України є сильна реакція на інфляцію, в той час як така реакція на фондовий ринок має бути незначимою. Крім того, отримані функції відгуку можуть використовуватися для підвищення ефективності проведення монетарних інтервенцій. Перспективними напрямами подальших досліджень у сфері моделювання монетарних процесів та фондового ринку є

удосконалення рівняння фінансової бульбашки та врахування таких особливостей економіки України, як значний розмір тіньового сектора, високий рівень доларизації економіки тощо.

2. Dissertation is devoted to the investigation of theoretical, methodological and empirical aspects of monetary policy modeling during asset market changes so as to achieve macroeconomic and financial stability. In this dissertation the conceptual basis for optimal monetary policy during stock market fluctuations is validated with such modern economic and mathematical instruments as newly constructed dynamic stochastic general equilibrium model for small open economy with financial accelerator and stock market bubble. Constructed and estimated based on Bayesian econometrics model allows analyzing the reaction of the Ukrainian economy to the external and internal shocks. In particular, the results show that optimal monetary rule of the National bank of Ukraine implies strong reaction to inflation and at the same time such reaction to the stock market should be insignificant. In addition, received impulse response functions can be used for increasing the efficiency of monetary policy interventions. Promising directions for future work in the field of monetary processes modeling during stock market fluctuations include improvements of financial bubble modeling and taking into account such features of the Ukrainian economy as large share of shadow sector, high degree of dollarization et cetera.

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. Лук'яненко Ірина Григорівна
2. Lukyanenko Irina Grygoryvna

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.11

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. Єлейко Василь Іванович

2. Єлейко Василь Іванович

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.11

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. Ніколайчук Сергій Анатолійович

2. Ніколайчук Сергій Анатолійович

Кваліфікація: к.е.н., 08.00.11

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 Вітлінський Вальдемар Володимирович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні

Вітлінський Вальдемар Володимирович

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Т.А.