Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0409U004845

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 29-10-2009

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Василенко Дмитро Володимирович
2. Vasylenko Dmitro Volodymyrovich

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: 08-10-2009

Спеціальність за освітою: 8.050104

Місце роботи здобувача: Державний вищий навчальний заклад "Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана"

Код за ЄДРПОУ: 02070884

Місцезнаходження: 03680, м.Київ, пр.Перемоги, 54/1

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): Д26.006.04

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: Державний вищий навчальний заклад "Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана"

Код за ЄДРПОУ: 02070884

Місцезнаходження: 03680, м.Київ, пр.Перемоги, 54/1

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.73.55

Тема дисертації:

1. Диверсифікація інвестиційної діяльності банків

2. Diversification of bank investment activity

Реферат/анотація:

1. Дисертаційну роботу присвячено вирішенню теоретичних та практичних проблем формування банківського інвестиційного портфеля на засадах диверсифікації. В роботі уточнено та доповнено визначення понять "банківські інвестиції", "інвестиційний ризик" та "диверсифікація інвестицій". Визначено роль диверсифікації в загальній системі управління інвестиційною діяльністю банку. Досліджено інвестиційні ризики та обґрунтовано доцільність врахування ризику недостатньої диверсифікації. Розроблено принципові підходи до формування диверсифікованого інвестиційного портфеля банку з врахуванням основних критеріїв вибору інструментів при вкладанні коштів в об'єкти інвестування з різними фінансовими характеристиками; особливостями регіонального розміщення вкладень, видами економічної діяльності та строками інвестування. Сформульовано пропозиції щодо удосконалення інструментарію та напрямів диверсифікації інвестиційної діяльності банку шляхом включення до банківського інвестиційного портфеля міжнародних інвестицій, об'єктів нерухомості та альтернативних активів, що дає змогу

забезпечити оптимальне співвідношення ризику та дохідності.

2. The dissertation is devoted to solution of theoretical and practical problems of bank investment portfolio formation on the basis of diversification. On the basis of analyzing of great number of scientific sources the economic content of the terms "bank investments", "investment risk", "investment diversification" has been specified and extended. The role of investment activity diversification in the context of control functions has been defined. This fact allows to evaluate the effectiveness of the process of investment portfolio formation and control in details on the whole as well as on every stage of control. The investment risks have been analyzed and expediency of insufficient diversification risk inclusion into their list has been proved. The fundamental approaches to bank diversification investment portfolio formation with taking into consideration the main criteria of instruments selection have been worked out. They allow to give prove to control strategy application and guarantee reasonable decisions taking as for allocation of funds among portfolio assets with different financial characteristics of an investment medium, its branch belonging, regional peculiarities of investments distribution and the terms of financial instrument repayment. The proposals of instruments and directions of bank investment activity diversification improvement by force of international investments, estate property objects and alternative assets inclusion into bank investment portfolio which allows to guarantee maximum risk and profitability correlation have been formulated.

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. Диба Михайло Іванович
2. Dyba Mihaiylo Ivanovich

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

VII. Відомості про офіційних опонентів та рецензентів

Офіційні опоненти

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Васильченко Зоя Миколаївна
2. Васильченко Зоя Миколаївна

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. Онікієнко Сергій Володимирович
2. Онікієнко Сергій Володимирович

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

Рецензенти

VIII. Заключні відомості

Власне Прізвище Ім'я По-батькові голови ради	Федосов Віктор Михайлович
Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні	Федосов Віктор Михайлович
Відповідальний за підготовку облікових документів	
Реєстратор	
Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності	Юрченко Т.А.