Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0519U000099

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 18-02-2019

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Краснова Ірина Вікторівна
2. Krasnova Iryna Viktorivna

Кваліфікація: к. е. н., 08.00.08

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: 22-01-2019

Спеціальність за освітою: Статистика

Місце роботи здобувача: ДВНЗ "Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана"

Код за ЄДРПОУ: 02070884

Місцезнаходження: проспект Перемоги, 54/1, м. Київ, Київ, 03057, Україна

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): Д 26.006.04

Повне найменування юридичної особи: ДВНЗ "Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана"

Код за ЄДРПОУ: 02070884

Місцезнаходження: проспект Перемоги, 54/1, м. Київ, Київ, 03057, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

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

Повне найменування юридичної особи: ДВНЗ "Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана"

Код за ЄДРПОУ: 02070884

Місцезнаходження: проспект Перемоги, 54/1, м. Київ, Київ, 03057, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.71.25, 06.73.75

Тема дисертації:

1. Управління активами на інтегрованих фінансових ринках

2. Asset management on integrated financial markets

Реферат/анотація:

1. У дисертаційній роботі розкрито теоретичні підходи до визначення поняття «інтегрований фінансовий ринок», визначено його властивості з погляду синергетичного підходу. Розкрито детермінанти, форми, способи фінансової інтеграції. Розкрита економічна сутність «похідних фінансових інструментів», що відрізняє їх від цінних паперів, та ринку навколо якого відбуваються процеси фінансової інтеграції. Визначено методи оцінювання. Сформульована авторська класифікація ризиків процесу фінансової інтеграції та каналів їх поширення. Розкрито економічний зміст поняття «фінансовий актив», його властивості, які доповнено характеристикою волатильності. Розроблена методика оцінки цінової динаміки активу в умовах нестабільності з використанням GARCH моделювання. Розроблено методичні засади оцінки рівня інтегрованості між окремими сегментами фінансового ринку. Розроблено методичні підходи щодо оцінювання глибини інтеграції фінансових риків, які апробовано на практичному матеріалі. Розроблено

авторський методичний підхід до оцінювання рівня інтегрованості сегментів фінансового ринку України. Визначено напрями та форми фінансової конвергенції та концентрації. Проаналізовано напрями та тенденції формування інвестиційних стратегій, розглянуто екосистемні фінансові інновації в розрізі тенденцій фінансової інтеграції. Обґрунтовані шляхи удосконалення системи ідентифікації та управління ринковими ризиками. Для мінімізації впливу ринкового ризику на ціну фінансового активу запропоновано шляхи модифікації компонентів моделі CAPM. Проведено кластеризацію бізнес-моделей за допомогою карт Кохонена. Надано пропозиції щодо вдосконалення підходів та параметрів державного регулювання на основі інституційно-мережевого підходу.

2. Theoretical approaches to the definition of the concept of «integrated financial market» are revealed, from the synergetic approach point of view its features are defined. Determinants, forms and methods of financial integration are revealed. The economic essence of «derivative financial instruments», which distinguishes them from securities, and the market around which, the processes of financial integration are taking place, are announced. Methods of evaluation are determined. Author's classification of risks of financial integration process and channels of their distribution is formulated. The economic substance of the «financial asset» concept, its features which are supplemented by the concept of volatility, is revealed. A technique has been developed for assessing asset price dynamics under conditions of instability using GARCH modelling. A methodological framework for assessing the level of integration between individual segments of the financial market. The methodical approaches on assessing the depth of financial risks integration, which have been tested on practical material, have been developed. An author's methodical approach on assessing the level of Ukraine's financial market segments integration is developed. The directions and forms of financial convergence and concentration are determined. Formation of investment strategies directions and tendencies are analysed, ecosystem financial innovations are considered in the context of financial integration tendencies. The ways of improving the identification system and market risk management are substantiated. In order to minimize the impact of market risk on the price of a financial asset, ways of modifying CAPM model are proposed. The clustering of business models is carried out using Kohonen maps. Proposals for improving approaches and management parameters based on institutional and network approaches are presented.

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. Примостка Людмила Олександрівна

2. Prymostka Liudmyla Oleksandrivna

Кваліфікація: д. е. н., 08.00.09

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. Примостка Людмила Олександрівна

2. Prymostka Liudmyla Oleksandrivna

Кваліфікація: д. е. н., 08.00.09

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. Корнєєв Володимир Вікторович

2. Korneev Volodymyr Viktorovich

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. Зимовець Владислав Вікторович
2. Zymovetsп Vladyslav Viktorovych

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. Азаренкова Галина Михайлівна
2. Azarenkova Galyna Mykhaylivna

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 Федосов Віктор Михайлович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні

Тимченко Олена Миколаївна

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Т.А.