Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0518U002750

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 22-12-2018

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Дзюба Павло Валерійович

2. Dziuba Pavlo Valeriiovych

Кваліфікація: к. е. н., 08.00.02

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: доктор 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: 19-12-2018

Спеціальність за освітою: Міжнародні економічні відносини

Місце роботи здобувача: Київський національний університет імені Тараса Шевченка

Код за ЄДРПОУ: 02070944

Місцезнаходження: вул. Володимирська, 64/13, м. Київ, Київ, 01601, 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 26.001.02

Повне найменування юридичної особи: Київський національний університет імені Тараса Шевченка

Код за ЄДРПОУ: 02070944

Місцезнаходження: вул. Володимирська, 64/13, м. Київ, Київ, 01601, 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: Київський національний університет імені Тараса Шевченка

Код за ЄДРПОУ: 02070944

Місцезнаходження: вул. Володимирська, 64/13, м. Київ, Київ, 01601, Україна

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. Еволюція парадигми міжнародного портфельного інвестування.

2. Evolution of International Portfolio Investing Paradigm.

Реферат/анотація:

1. У дисертації розроблено біпарадигмальну модель теорії міжнародного портфельного інвестування. Виявлено основні етапи еволюції портфельної та вартісної парадигм, передумови їхніх змін та перспективи розвитку теорії міжнародного портфельного інвестування. Визначено гносеологічні ознаки обох парадигм. Ідентифіковано окремі позапарадигмальні теорії та підходи, визначено їхнє місце у теорії міжнародного портфельного інвестування. Виокремлено й типологізовано найпоширеніші підходи до оптимізації міжнародних інвестиційних портфелів. Обґрунтовано, що концепція міжнародної диверсифікації інвестиційних портфелів є новим етапом еволюції портфельної парадигми міжнародного інвестування. Доведено, що її поява є реакцією парадигми на важливі зміни, котрі відбувалися у міжнародних економічних відносинах. Розраховано та проаналізовано ризики й дохідності ринків акцій різного типу. Досліджено динаміку та структуру глобальних портфельних пасивів і міжнародних портфельних пасивів України.

Проведено багатокритеріальну кластеризацію 66 ринків різних типів методом k-середніх, визначено шість сталих конструктів залучення іноземних портфельних інвестицій на ринки акцій.

2. The bi-paradigmatic model of international portfolio investing theory is developed. Core stages of portfolio and value investing paradigms evolution, preconditions and terms of their shifts are revealed. Prospects of international portfolio investing theory are defined. Comparative analysis of both paradigms is carried out, their epistemological features and tangency points are defined. Independent theories and approaches that do not fall within the paradigm are identified, their position in international portfolio investing theory are defined, their relationship with its other components is determined. The existence of contradiction between portfolio paradigm basic concepts such as the efficient portfolio concept and the diversification concept is justified. This contradiction is one of the paradigm development and improvement factors. The most widely used approaches to international investment portfolios optimization are revealed and broken down into types. The concept of international investment portfolios diversification is proved to be the new stage of international portfolio investing paradigm evolution. Its appearance is proved to reflect the paradigm response to important shifts in world economy and international economic relations in that time. The significance of investment portfolios international diversification is shown to reduce in the course of time and during periods of markets increased volatility. Home bias as one of the most widely spread behavioral deviations of investors' decisions from rational basis is explored. It is also recognized as the factor impeding international flows of portfolio investments. Local and international factors of securities premiums and main international models of their estimation are considered. The dual and overall impact of international factors on expected returns is justified. The level of systematic risk turns out to be smaller in international market than in domestic markets. Risks and returns of individual equity markets, their dynamics and interrelation, particularly during markets increased volatility periods are calculated and analyzed. The methodology of asymmetry in risks and returns dynamics evaluation is developed, its testing using the empirical data is carried out. Structural asymmetry persistent frames are detected. Exchange rate risks of portfolio investing in frontier equity markets including Ukraine in terms of USD and EUR are estimated. The methodology of global aggregated risk aversion assessment is developed; its empirical testing is carried out. The dynamics and structure of global portfolio liabilities and international portfolio liabilities of Ukraine are analyzed. Trends and patterns of their development are defined. Imbalances in the global market of international portfolio investments are ascertained, the special local equity market external filling ratio is developed for their investigation. The multi-criterion clustering of 66 markets of different types using the k-means method is conducted, six established patterns of attracting foreign portfolio investments on equity markets are defined. Statistical and substantive features of defined clusters are singled out.

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. Рогач Олександр Ігорович

2. Rohach Oleksandr Ihorovych

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

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Рогач Олександр Ігорович

2. Rohach Oleksandr Ihorovych

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. Орєхова Тетяна Вікторівна

2. Orekhova Tetyana Viktorivna

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

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Стукало Наталія Вадимівна

2. Stukalo Nataliia Vadymivna

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

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Білорус Олег Григорович

2. Bilorus Oleh

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

Рецензенти

VIII. Заключні відомості

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