Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0825U000244

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 14-01-2025

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Петрук Анастасія Олександрівна

2. Anastasiia Petruk

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: доктор філософії

Аспірантура/Докторантура: так

Шифр наукової спеціальності: 072

Назва наукової спеціальності: Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок

Галузь / галузі знань:

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Фінанси, банківська справа та страхування

Дата захисту: 18-08-2023

Спеціальність за освітою: фінанси, банківська справа та струхвання

Місце роботи здобувача: Державний університет "Житомирська політехніка"

Код за ЄДРПОУ: 05407870

Місцезнаходження: вул. Чуднівська, буд. 103, Житомир, Житомирський р-н., 10005, Україна

Форма власності: Державна

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR:

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): PhD 1896

Повне найменування юридичної особи: Державний університет "Житомирська політехніка"

Код за ЄДРПОУ: 05407870

Місцезнаходження: вул. Чуднівська, буд. 103, Житомир, Житомирський р-н., 10005, Україна

Форма власності: Державна

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR:

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

Повне найменування юридичної особи: Державний університет "Житомирська політехніка"

Код за ЄДРПОУ: 05407870

Місцезнаходження: вул. Чуднівська, буд. 103, Житомир, Житомирський р-н., 10005, Україна

Форма власності: Державна

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR:

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації: Українська

Коди тематичних рубрик: 82.05.09, 06.73.35, 06.73.55

Тема дисертації:

1. Фінансова стабільність комерційних банків з урахуванням операцій з похідними фінансовими інструментами

2. Financial stability of commercial banks during operations with derivative financial instruments

Реферат/анотація:

1. Дисертація присвячена комплексному дослідженню, поглибленню теоретичних засад, розширенню методичного інструментарію та формуванню організаційних положень щодо забезпечення фінансової стабільності комерційних банків із урахуванням операцій з похідними фінансовими інструментами. У роботі здійснено аналіз науково-методологічних підходів взаємозв'язку фінансової стабільності (фінансової безпеки) та операцій з похідними фінансовими інструментами. Встановлено, що забезпечення фінансової стабільності потребує системного підходу до взаємодії суб'єктів банківської системи (комерційні банки, НБУ, інші регулятори), який має призвести до певного синергетичного ефекту в досягненні поставлених завдань, за рахунок своєчасного використання превентивних заходів мікро- та макропруденційного регулювання і належної організації банківського менеджменту на рівні окремої установи. Здійснено аналіз економічної сутності похідних фінансових інструментів у наукових дослідженнях та нормативно-правовій базі, на основі якого зроблено висновок про наявність суперечностей та прогалин у вітчизняному законодавстві, які

перешкоджають створенню ефективної законодавчої бази регулювання операцій комерційних банків з ПФІ. Уточнено ієрархічну класифікацію ПФІ за допомогою фасетного методу, що дозволило врахувати більшість характеристик, з метою упорядкування і систематизації ПФІ, а також усунути труднощі під час виявлення можливих загроз та оцінки ризиків, які виникають при здійсненні операцій з ними.

2. The thesis is devoted to comprehensive research, deepening of theoretical foundations, expansion of methodological tools and formation of organizational provisions for ensuring financial stability of commercial banks during transactions with derivative financial instruments. The thesis analyzes the scientific and methodological approaches of the relationship between financial stability (financial security) and operations with derivative financial instruments. It was established that ensuring financial stability requires a systematic approach to the interaction of banking system subjects (commercial banks, NBU, other regulators), which should lead to a certain synergistic effect in achieving the set objectives, due to the timely use of preventive measures of micro- and macroprudential regulation and proper organization of bank management at the level of a separate institution. The thesis contains an analysis of the economic essence of derivative financial instruments in scientific research and the legal framework, on the basis of which a conclusion was made about the presence of contradictions and gaps in domestic legislation that prevent the creation of an effective legal framework for regulating the operations of commercial banks with derivative financial instruments. The hierarchical classification of derivative financial instruments was refined using the facet method, which made it possible to consider most of the characteristics in order to organize and systematize derivative financial instruments, as well as to eliminate difficulties in identifying possible threats and assessing risks that arise when conducting transactions with them.

Державний реєстраційний номер ДіР:

Пріоритетний напрям розвитку науки і техніки: Фундаментальні наукові дослідження з найбільш важливих проблем розвитку науково-технічного, соціально-економічного, суспільно-політичного, людського потенціалу для забезпечення конкурентоспроможності України у світі та сталого розвитку суспільства і держави

Стратегічний пріоритетний напрям інноваційної діяльності: Не застосовується

Підсумки дослідження: Нове вирішення актуального наукового завдання

Публікації:

- 1. Petruk A. Risk regulation of banking activities with derivative financial instruments: a comparative aspect. European Cooperation. 2020. №1(45). P. 39-50
- 2. Petruk A., Stadniichuk R. Credit derivatives in banking: benefits and threats. European Cooperation. 2020. №3(47). P. 7-16. URL: https://doi.org/10.32070/ec.v3i47.85
- 3. Petruk A. Proposals for improving Ukrainian derivatives market regulation. European Cooperation. 2021. Vol. 3(51). pp. 34–51
- 4. Петрук А.О. Проблеми та перспективи розвитку методів регулювання інвестиційної діяльності банків, пов'язаної з похідними фінансовими інструментами. Проблеми теорії та методології бухгалтерського обліку, контролю і аналізу. 2019. № 2 (43). С. 61-64
- 5. Петрук А.О. Аналіз світового та вітчизняного ринків похідних фінансових інструментів. Економіка, управління та адміністрування. 2022. № 2 (100). С. 62-75
- 6. Петрук А.О. Розвиток підходів до визначення поняття «похідні фінансові інструменти» та їх класифікації. Ефективна економіка. 2022. № 6. URL: http://www.economy.nayka.com.ua/
- 7. Петрук О.М., Петрук А.О. Теоретичні засади забезпечення безпеки операцій банків з похідними фінансовими інструментами. Економіка, управління та адміністрування. 2022. № 3(101). С. 87-98
- 8. Petruk O.M., Novak O.S., Petruk A.O., Radchenko N.H. Determinants of Volatility of the Derivative Financial Instrument in Ukraine. Universal Journal of Accounting and Finance. 2021. Vol. 9(4). pp. 653-666

- 9. Петрук А.О. Регулювання похідних фінансових інструментів на ринку фінансових послуг. Розвиток фінансових відносин суб'єктів господарювання в умовах динамічного зовнішнього середовища: матеріали Інтернет-конференції, м. Житомир, 2018. С. 278. URL: https://conf.ztu.edu.ua/wp-content/uploads/2019/01/vse.pdf
- 10. Петрук А.О. Операції комерційних банків з похідними фінансовими інструментами. Всеукраїнська науковопрактична online конференція здобувачів вищої освіти і молодих учених, присвяченої Дню науки. Житомир, 2019. С. 977. URL: https://conf.ztu.edu.ua/tezy-do-dnya-nauky-15-17-travnya-2019-r/
- 11. Петрук А.О. Необхідність та практика запровадження валютних та процентних свопів в Україні. Сучасні виклики сталого розвитку бізнесу: матеріали Міжнародної наукової конференції (Житомир, 5-6 листопада 2020 р.). Житомир, 2020. С. 301-302. URL: https://conf.ztu.edu.ua/suchasni-vyklyky-stalogo-rozvytku-biznesu-5-6- lystopada-2020-r/
- 12. Петрук А.О. Розвиток ринку похідних фінансових інструментів в Україні: деривативи на криптовалюту. Економіка та право в умовах глобалізації: матеріали Міжнародної науково-практичної конференції (Полтава, 15 лютого 2021 р.). Полтава, 2021. С. 87-88. URL: http://www.economics.in.ua/2021/03/blog-post.html
- 13. Петрук А.О. Регулювання світового ринку похідних фінансових інструментів. Всеукраїнська online конференція здобувачів вищої освіти і молодих учених, присвяченої Дню науки (м. Житомир, 11-15 травня 2021). Житомир, 2021. С. 303. URL: https://conf.ztu.edu.ua/konferentsiya-prysvyachena-dnyu-nauky-11-15-travnya- 2021-r/
- 14. Петрук А.О. Макроекономічне стрес-тестування банків як інструмент забезпечення стійкості банківської системи. Сучасні виклики сталого розвитку бізнесу: матеріали II Міжнародної науково-практичної конференції з проблем вищої освіти і науки (м. Житомир, 04-05 листопада 2021). Житомир, 2021. С. 313. URL: https://conf.ztu.edu.ua/wp-content/uploads/2021/12/full-text.pdf
- 15. Петрук. А.О. Макропруденційний інструментарій як комплекс управління банківськими ризиками. Вплив інноваційних змін на розвиток суспільства: управлінські та соціальноекономічні аспект: матеріали Всеукраїнської on-line конференції здобувачів вищої освіти і молодих учених, присвяченої Дню науки (м. Житомир, 16-20, 26 травня 2022). Житомир, 2022. С. 239. URL: https://conf.ztu.edu.ua/konferentsiya-prysvyachena-dnyu-nauky-16-20-26-travnya-2022-r/

Наукова (науково-технічна) продукція:

Соціально-економічна спрямованість:

Охоронні документи на ОПІВ:

Впровадження результатів дисертації: Впроваджено

Зв'язок з науковими темами: 0120U102752

VI. Відомості про наукового керівника/керівників (консультанта)

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Петрук Олександр Михайлович

2. Oleksandr Petruk

Кваліфікація: д.е.н., професор, 08.00.09

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи: Державний університет "Житомирська політехніка"

Код за ЄДРПОУ: 05407870

Місцезнаходження: вул. Чуднівська, буд. 103, Житомир, Житомирський р-н., 10005, Україна

Форма власності: Державна

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR:

VII. Відомості про офіційних опонентів та рецензентів

Офіційні опоненти

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Лисенок Олексій Володимирович
2. Oleksii Lysenok

Кваліфікація: д.е.н., доц., 08.00.08

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи: Національний університет харчових технологій

Код за ЄДРПОУ: 02070938

Місцезнаходження: вул. Володимирська, буд. 68, Київ, 01601, Україна

Форма власності: Державна

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR:

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Коваленко Юлія Михайлівна
2. Yuliia Kovalenko

Кваліфікація: д.е.н., професор, 08.00.08

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи: Державний податковий університет

Код за ЄДРПОУ: 44550814

Місцезнаходження: вул. Університетська, буд. 31, Ірпінь, 08201, Україна

Форма власності: Державна

Сфера управління: Міністерство фінансів України

Ідентифікатор ROR:

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Трусова Наталія Вікторівна

2. Nataliia TRUSOVA

Кваліфікація: д. е. н., професор, 08.00.08

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи: Таврійський державний агротехнологічний університет імені Дмитра Моторного

Код за ЄДРПОУ: 00493698

Місцезнаходження: проспект Богдана Хмельницького, 18, Мелітополь, Мелітопольський р-н., 72312, Україна

Форма власності: Державна

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR:

Рецензенти

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Дячек Світлана Михайлівна

2. Svitlana Dyachek

Кваліфікація: к.е.н., доц., 08.00.09

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи: Державний університет "Житомирська політехніка"

Код за ЄДРПОУ: 05407870

Місцезнаходження: вул. Чуднівська, буд. 103, Житомир, Житомирський р-н., 10005, Україна

Форма власності: Державна

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR:

VIII. Заключні відомості

Власне Прізвище Ім'я По-батькові голови ради	Виговська Наталія Георгіївна
Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні	Виговська Наталія Георгіївна
Відповідальний за підготовку облікових документів	Довгалюк Віта Валентинівна
Реєстратор	УкрІНТЕІ

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Тетяна Анатоліївна