Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0821U102123

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 13-07-2021

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Філатова Ганна Петрівна

2. Filatova Hanna P.

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: доктор філософії

Аспірантура/Докторантура: так

Шифр наукової спеціальності: 072

Назва наукової спеціальності: Управління та адміністрування. Фінанси, банківська справа та страхування

Галузь / галузі знань:

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 23-06-2021

Спеціальність за освітою: облік і аудит

Місце роботи здобувача: Сумський державний університет

Код за ЄДРПОУ: 05408289

Місцезнаходження: вул. Римського-Корсакова, буд. 2, м. Суми, Сумський р-н., Сумська обл., 40007, 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): ДФ 55.051.019

Повне найменування юридичної особи: Сумський державний університет

Код за ЄДРПОУ: 05408289

Місцезнаходження: вул. Римського-Корсакова, буд. 2, м. Суми, Сумський р-н., Сумська обл., 40007, 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: Сумський державний університет

Код за ЄДРПОУ: 05408289

Місцезнаходження: вул. Римського-Корсакова, буд. 2, м. Суми, Сумський р-н., Сумська обл., 40007, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.73, 06.75

Тема дисертації:

1. Боргова безпека в системі забезпечення економічної безпеки держави

2. Debt security in the system of state economic security

Реферат/анотація:

1. Дисертаційна робота присвячена вирішенню наукової проблеми розвитку теоретичних засад та практичних рекомендацій й удосконалення науково-методичних підходів щодо забезпечення боргової безпеки в системі економічної безпеки держави. У дисертаційній роботі узагальнено існуючі наукові напрацювання щодо визначення економічної сутності поняття «боргова безпека держави», у результаті чого її запропоновано розуміти як невід'ємну складову фінансово-економічної безпеки держави, яка характеризується оптимальним рівнем та структурою державного боргу з урахуванням вартості його обслуговування з метою забезпечення стійкості фінансової системи держави та її фінансового суверенітету, підтримки належного рівня платоспроможності та кредитного рейтингу. На відміну від існуючих підходів запропоноване визначення спирається на структурний, системний, функціональний, управлінський та ризик-орієнтований підходи, що дозволяє врахувати усі складові боргової безпеки держави, забезпечити

транспарентність та ефективність управління нею. Запропоновано розглядати управління борговою безпекою держави, як сукупність відповідних заходів, що здійснюються державою в особі уповноважених органів щодо планування, організації, оцінювання, прогнозування, координації, моніторингу, розробки ефективних методів і важелів щодо збереження боргового навантаження на безпечному рівні, а також скороченню вартості обслуговування державного боргу з метою забезпечення фінансово-економічної безпеки держави. У роботі обґрунтовано, що боргова безпека є невід'ємною частиною економічної безпеки держави. З цією метою розроблено структурно-логічну схему, у якій відображено місце та визначено роль боргової безпеки в системі економічної безпеки держави та яка передбачає виокремлення відповідних підсистем, принципів, функцій, об'єктів і суб'єктів. Це дозволило окреслити вектор трансформації існуючої системи забезпечення боргової безпеки держави з метою її конвергенції з міжнародними принципами. У дисертації удосконалено науково-методичний підхід до визначення стану боргової безпеки держави на основі кількісного оцінювання релевантних показників, їх подальшої кластеризації, який, на відміну від існуючих, дозволяє ідентифікувати основні потенційні загрози і джерела нестабільності, спрогнозувати їх майбутню динаміку та розрахувати інтегральний індекс боргової безпеки. Розроблено та запропоновано до практичного використання науково-методичний підхід щодо коротко- та середньострокового прогнозування державного боргу за допомогою авторегресійної моделі ARMA. Зазначений підхід передбачає визначення рівня персистентності державного боргу шляхом проведення R/S аналізу для розрахунку експоненти Херста. Запропонований в дисертації науково-методичний підхід дозволяє визначати динаміку державного боргу України та отримати прогнозні його значення на найближчі три роки. У роботі виокремлено основні чинники, що впливають на боргову політику держави. Запропоновано науково-методичне підґрунтя оцінювання впливу показників економічного розвитку на державний борг України на основі системи регресійних рівнянь з розподіленим лагом (за методом Алмона). Запропонований науково-методичний інструментарій сприятиме вирішенню двох основних завдань: 1) відображення ключових взаємозв'язків в економіці, в яких безпосередньо чи опосередковано бере участь державний борг; 2) забезпечення можливості прогнозування державного боргу в майбутніх періодах та визначення його впливу на основні макроекономічні показники і процеси. Визначено, що вагомого значення серед інструментів забезпечення боргової безпеки держави набуває моніторинг як система заходів, що передбачає підвищення рівня фінансової, а відповідно й економічної безпеки держави. У роботі обґрунтовано методичні засади моніторингу ефективності управління борговою безпекою держави шляхом проведення узагальненого оцінювання відповідності національної практики розкриття інформації про боргову сферу в Україні міжнародним принципам забезпечення економічної безпеки держави, що дозволяє підвищити ефективність системи забезпечення боргової безпеки.

2. The dissertation is devoted to solving the scientific problem of debt security in the system of state economic security, as well as its theoretical bases development, improvement of the existing scientific and methodical approaches, and its practical provisions. The research summarizes the existing scientific studies of «state debt security» concept. As a result, it is suggested to identify it as an integral part of the state financial and economic security, characterized by optimal level and structure of public debt with considering the cost of its servicing to ensure the state`s financial system stability and its financial sovereignty, maintaining an adequate solvency level and credit rating. In contrast to other approaches, the proposed definition is based on a structural, systemic, functional, managerial and risk-oriented standpoint, which allows to consider all components of state debt security to ensure transparency and efficiency of its management. The author suggests considering «state debt security management» concept as a set of appropriate measures taken by the state and its authorized bodies to coordinate, organize, evaluate, monitor, plan, forecast, develop effective methods and levers regarding maintaining debt burden at a safe level and reduce the servicing costs of external debt in order to ensure the financial and economic security of the state. It is outlined that debt security is an integral part of state economic security. In order to prove this a structural and logical scheme has been offered, which introduces place and role of debt security in the system of state economic security and the separates its subsystems, principles, functions, objects and entities. Eventually, it allows us to outline the vector of transformation of the current state debt security

system in order to converge it with international principles. The dissertation provides a list of key indicators of debt security, and their threshold values in Ukraine in comparison with the world practice. Besides, scientific and methodological approach to determining the state debt security based on quantitative assessment of relevant indicators is substantiated, which, in contrast to existing ones, allows to identify significant potential threats and causes of instability, predict their future dynamics and calculate integrated debt security index. A scientific and methodological approach to short- and medium-term forecasting of public debt includes the autoregressive model (ARMA) developed and proposed for practical use. It helps identifying the persistence level of public debt by calculating the Hearst exponent and conducting an R/S analysis. The provided in the dissertation model allows to determine the dynamics of public debt of Ukraine and get its forecast values for the next three years. The study provides a scientific and methodological bases for assessing the impact of indicators of economic development on Ukraine`s public debt based on a system of regression equations with distributed lag (Almon model). The proposed scientific and methodological approach will solve two main tasks: 1) reflection of crucial relationships in the economy, which directly or indirectly involves public debt; 2) providing the ability to forecast external debt in future periods and determine its impact on key macroeconomic indicators and processes. It is determined that monitoring as a system of measures becomes more important for ensuring the state debt security as it might increase the level of financial and, accordingly, state's economic security. The dissertation confirms the main methodological principles of monitoring the effectiveness of state debt security management by conducting a generalized assessment of compliance of national practice of disclosure on the debt sector in Ukraine with international principles of state economic security, which increases the effectiveness of the debt security system.

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. Журавка Федір Олександрович
2. Zhuravka Fedir

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

VII. Відомості про офіційних опонентів та рецензентів

Офіційні опоненти

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Гусаковська Тетяна Олександрівна

2. Gusakovska Tetjana O.

Кваліфікація: к. е. н., 08.00.04

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. Маргасова Вікторія Генадіївна

2. Marhasova Viktoriia H.

Кваліфікація: д. е. н., 08.00.03

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Рецензенти

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Школьник Інна Олександрівна

2. Shkolnyk Inna O.

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. Захаркіна Людмила Сергіївна

2. Zakharkina Liudmyla S.

Кваліфікація: к. е. н., 08.00.04

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

VIII. Заключні відомості

Власне Прізвище Ім'я По-батькові голови ради Бойко Антон Олександрович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Бойко Антон Олександрович

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Т.А.