Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0824U000477

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 18-01-2024

Статус: Наказ про видачу диплома

Реквізити наказу МОН / наказу закладу: Наказ № 247-С від 06.03.2024, Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця, МОН України

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Полянський Владислав Олександрович
2. Vladyslav Polianskyi

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: доктор філософії

Аспірантура/Докторантура: так

Шифр наукової спеціальності: 051

Назва наукової спеціальності: Економіка

Галузь / галузі знань: соціальні та поведінкові науки

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Економіка

Дата захисту: 12-02-2024

Спеціальність за освітою: Економіка

Місце роботи здобувача: Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця

Код за ЄДРПОУ: 02071211

Місцезнаходження: проспект Науки, буд. 9-а, Харків, Харківський р-н., 61166, 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): 3716

Повне найменування юридичної особи: Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця

Код за ЄДРПОУ: 02071211

Місцезнаходження: проспект Науки, буд. 9-а, Харків, Харківський р-н., 61166, 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: Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця

Код за ЄДРПОУ: 02071211

Місцезнаходження: проспект Науки, буд. 9-а, Харків, Харківський р-н., 61166, Україна

Форма власності: Державна

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR:

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації: Українська

Коди тематичних рубрик: 06.01.01, 06.04.13

Тема дисертації:

1. Моделі оцінки впливу «шоків» на фінансову безпеку макроекономічних систем.
2. Models for assessing the impact of «shocks» on the financial security of macroeconomic systems.

Реферат:

1. Дисертаційна робота присвячена розробці комплексу моделей оцінки впливу «шоків» на фінансову безпеку макроекономічних систем (МС), які дозволяють підвищити наукову обґрунтованість оцінки глобальної стійкості МС до впливу «шоків», визначити прогнозний рівень фінансової безпеки, виділити локальні «критичні» підсистеми та налаштувати ефективні механізми забезпечення фінансової безпеки. Досліджено теоретико-методичні засади впливу «шоків» на фінансову безпеку МС: систематизовано характеристики «шоку»; виділено класифікаційні ознаки «шоків»; систематизовані сучасні підходи до моделювання впливу «шоків» на безпеку МС методами Data Science; виділено напрями вдосконалення та подальшого розвитку модельного базису антисипативного управління безпекою МС; обґрунтовано вибір математичного інструментарію розробки комплексу моделей оцінки впливу «шоків» на фінансову безпеку МС. Розроблено концептуальну схему дослідження, яка представлена як комплекс узгоджених, взаємопов'язаних модулів та

моделей. Удосконалено моделі оцінки стійкості МС до екзогенних «шоків», які засновані на комплексному використанні методів кластерного аналізу і нейронних мереж Кохонена, що дозволяє підвищити обґрунтованість оцінки стійкості економіки країни до впливу екзогенних «шоків», дослідити міжкластерну міграцію елементів і здійснити оцінювання рівня глобальної стійкості МС з урахуванням міжкластерної міграції. Розроблено інструментарій оцінювання впливу соціально-економічних факторів на вразливість МС до «шоків», який базується на застосуванні методів класифікації без навчання, нечіткої логіки та дозволяє визначити домінантні соціально-економічні ризики для різних за ступенем вразливості до екзогенних «шоків» груп МС. Сформовано систему індикаторів раннього попередження криз у механізмах управління безпекою, що полягає у застосуванні композитних індексів невизначеності на основі методу головних компонент, що дозволяє провести раннє розпізнавання кризових процесів та підвищити обґрунтованість оцінки їх тривалості в умовах дії «шоків». Дістали подальшого розвитку моделі оцінки та аналізу рівня фінансової безпеки МС, які засновані на використанні методів таксономії, методів аналізу панельних даних, і дозволяють визначити найбільш значущі загрози фінансовій безпеці МС різних за рівнем стійкості до екзогенних «шоків» груп, сформувати перелік факторів, які доцільно враховувати під час розробки сценаріїв стрес-тестування. Запропоновано методичні положення оцінювання просторової реакції індикаторів фінансової безпеки МС на вплив «шоків», відмінність яких полягає у комплексному використанні методів кластерного аналізу, вибору репрезентантів груп, VAR-моделей показників фінансової безпеки, VAR-моделей з екзогенними змінними розвитку реального сектора економіки, розвитку глобальної економіки, що дозволяють оцінити тривалість та характер флуктуацій індикаторів фінансової безпеки внаслідок впливу «шоків», виявити найуразливіші підсистеми фінансової безпеки. Дістали подальшого розвитку моделі оцінки впливу енергетичного «шоку» на індикатори фінансової безпеки МС в контексті розвитку технології VAR-моделювання та розробки стрес-сценаріїв фінансової безпеки на підставі застосування TVAR-моделей, ARDL-моделей, що дозволяють визначити диференційовані режими енергетичної безпеки та значущість впливу інформаційного каналу на динаміку індикаторів енергетичної безпеки та, як наслідок, фінансової безпеки. Практична цінність роботи полягає у розробці методичних підходів до побудови моделей оцінки впливу «шоків» на безпеку економічних систем, які є універсальними та можуть бути впроваджені в діяльність економічних систем різного рівня ієрархії для формування стрес-сценаріїв, визначення прогнозного рівня безпеки, формування стратегій забезпечення безпеки, попередження кризових ситуацій. Результати дослідження впроваджено у практичній діяльності підприємств у сфері інформаційних технологій та комп'ютерних систем: ТОВ «СОФТВЕА-ЕКСПЕРТ» (довідка № 14 від 15.10.2020 р.), ТОВ «РАЙЗ 19» (довідка № 01/02/22 від 10.02.2022 р.) Обґрунтовані в роботі положення також використано у навчальному процесі ХНЕУ ім. С. Кузнеця при викладанні дисциплін «Методи економіко-статистичних досліджень», «Методи та моделі DATA SCIENCE», «Економетрика-2» (довідка № 22/88-02-28 від 19.07.2022 р.).

2. The dissertation is devoted to the development of a set of models for assessing the impact of «shocks» on the financial security of macroeconomic systems (MS), which allow to increase the scientific validity of the assessment of the global stability of the MS to the impact of «shocks», to determine the forecast level of financial security, to identify local «critical» subsystems and to set up effective mechanisms for ensuring financial security. The theoretical and methodological principles of the influence of «shocks» on the financial security of the MS were studied: the characteristics of the «shock» were systematized; the classification features of «shocks» are highlighted; systematized modern approaches to modeling the impact of «shocks» on the security of MS using Data Science methods; directions for improvement and further development of the model basis of anticipatory safety management of the MC are highlighted; the choice of mathematical tools for the development of a set of models for assessing the impact of «shocks» on the financial security of the MS is substantiated. A conceptual study scheme has been developed, which is presented as a complex of coordinated, interconnected modules and models. Models for assessing the resilience of the MS to exogenous «shocks» have been improved, which are based on the complex use of methods of cluster analysis and Kohonen's neural networks, which makes it possible to increase the validity of assessing the resilience of the country's economy to the influence of exogenous «shocks»,

to investigate the intercluster migration of elements and to carry out an assessment of the level of global stability of the MS taking into account intercluster migration. A toolkit for assessing the impact of socioeconomic factors on MS vulnerability to «shocks» has been developed, which is based on the application of classification methods without learning, fuzzy logic, and allows determining the dominant socioeconomic risks for MS groups with different degrees of vulnerability to exogenous «shocks». A system of indicators for early warning of crises in security management mechanisms has been formed, which consists in the application of composite indices of uncertainty based on the method of principal components, which allows early recognition of crisis processes and increases the validity of assessing their duration under the conditions of «shocks». The model for assessing and analyzing the level of financial security of MS was further developed, which is based on the use of taxonomy methods, methods of panel data analysis, and allows to determine the most significant threats to the financial security of MS of groups of different levels of resistance to exogenous «shocks», to form a list of factors that are expedient to consider when developing stress testing scenarios. Methodical provisions for evaluating the spatial response of financial security indicators of the MS to the impact of «shocks» are proposed, the difference of which is the complex use of cluster analysis methods, the selection of group representatives, VAR models of financial security indicators, VAR models with exogenous variables of the development of the real sector of the economy, the development of global of the economy, allowing to assess the duration and nature of fluctuations of financial security indicators due to the impact of «shocks», to identify the most vulnerable subsystems of financial security. Further development of the model for assessing the impact of an energy «shock» on the financial security indicators of the MS was obtained in the context of the development of the VAR-modeling technology and the development of stress scenarios of financial security based on the use of TVAR-models, ARDL-models, which allow to determine differentiated modes of energy security and the significance of the impact information channel on the dynamics of indicators of energy security and, as a result, financial security. The practical value of the work lies in the development of methodical approaches to the construction of models for assessing the impact of «shocks» on the security of economic systems, which are universal and can be implemented in the activities of economic systems of different levels of the hierarchy for the formation of stress scenarios, the determination of the predictive level of security, the formation of security strategies, prevention of crisis situations. The results of the research are implemented in the practical activities of enterprises in the field of information technologies and computer systems: SOFTWARE-EXPERT LLC (reference No. 14 dated 15.10.2020), RISE 19 LLC (No. 01/02/22 dated 10.02.2022). The provisions substantiated in the work are also used in the educational process of Simon Kuznets KhNUE when teaching the disciplines «Methods of economic and statistical research», «Methods and models of DATA SCIENCE», «Econometrics-2» (No. 22/88-02-28 dated 19.07.2022).

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: Теоретичне узагальнення і вирішення важливої наукової проблеми

Публікації:

- 1. Полянський В. О. Моделі оцінки стійкості макроекономічних систем до екзогенних «шоків». Вісник Харківського національного університету імені В. Н. Каразіна серія «Економічна». 2022. № 102. С. 57–68. DOI: https://doi.org/10.26565/2311-2379-2022-102-07 Посилання: https://periodicals.karazin.ua/economy/article/view/20375
- 2. Полянський В. О. Аналіз прогностичних властивостей композитних індексів невизначеності в системах превентивного управління кризами. Бізнес Інформ. 2022. №5. С. 84–91. DOI:

https://doi.org/10.32983/2222-4459-2022-5-84-91 Посилання: https://www.business-inform.net/export_pdf/business-inform-2022-5_0-pages-84_91.pdf

- 3. Полянський В. О. TVAR-моделі індикаторів фінансової безпеки макроекономічних систем: оцінка впливу енергетичного “шоку”. Управління розвитком. 2022. Вип. 20. № 1. С. 18-24. DOI: https://doi.org/10.57111/devt.20(1).2022.18-24 Посилання: https://devma.com.ua/en/journals/t-20-1-2022
- 4. Guryanova, L., Milevskiy, S., Bogachkova, L., Lytovchenko, I., Polianskyi, V. Models of Assessment and Analysis in Security Management Systems / L. Guryanova et al. 2018 International Scientific-Practical Conference Problems of Infocommunications. Science and Technology (PIC S&T), Kharkiv, Ukraine, 9–12 October 2018. URL: https://doi.org/10.1109/infocommst.2018.8632066. (SCOPUS укр) DOI: https://doi.org/10.1109/infocommst.2018.8632066 Посилання: https://ieeexplore.ieee.org/document/8632066/

Наукова (науково-технічна) продукція:

Соціально-економічна спрямованість:

Охоронні документи на ОПІВ:

Впровадження результатів дисертації: Впроваджено

Зв'язок з науковими темами: 0118U000058; 0120U103218

VI. Відомості про наукового керівника/керівників (консультанта)

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Гур'янова Лідія Семенівна

2. Lidiya S. Guryanova

Кваліфікація: д. е. н., професор, 08.00.11

Ідентифікатор ORCID ID: 0000-0002-2009-1451

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи: Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця

Код за ЄДРПОУ: 02071211

Місцезнаходження: проспект Науки, буд. 9-а, Харків, Харківський р-н., 61166, 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. Стрельченко Інна Іллівна

2. Inna I. Strelchenko

Кваліфікація: д. е. н., професор, 08.00.11

Ідентифікатор ORCID ID: 0000-0001-5179-4304

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи: Вищий навчальний заклад "Університет імені Альфреда Нобеля"

Код за ЄДРПОУ: 20201672

Місцезнаходження: вул. Січеславська Набережна, буд. 18, Дніпро, Дніпровський р-н., 49000, Україна

Форма власності: Державна

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR:

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Харламова Ганна Олексіївна

2. Ganna O. Kharlamova

Кваліфікація: д. е. н., професор, 08.00.11

Ідентифікатор ORCID ID: 0000-0003-3614-712X

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи: Київський національний університет імені Тараса Шевченка

Код за ЄДРПОУ: 02070944

Місцезнаходження: вул. Володимирська, буд. 60, Київ, 01033, Україна

Форма власності: Державна

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR:

Рецензенти

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Чаговець Любов Олексіївна

2. Liubov O. Chahovets

Кваліфікація: к. е. н., доц., 08.00.11

Ідентифікатор ORCID ID: 0000-0003-4064-9712

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи: Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця

Код за ЄДРПОУ: 02071211

Місцезнаходження: проспект Науки, буд. 9-а, Харків, Харківський р-н., 61166, Україна

Форма власності: Державна

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR:

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Шабельник Тетяна Володимирівна
2. Tetyana V. Shabelnik

Кваліфікація: д. е. н., професор, 08.00.11

Ідентифікатор ORCID ID: 0000-0001-9798-391X

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи: Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця

Код за ЄДРПОУ: 02071211

Місцезнаходження: проспект Науки, буд. 9-а, Харків, Харківський р-н., 61166, Україна

Форма власності: Державна

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR:

VIII. Заключні відомості

Власне Прізвище Ім'я По-батькові голови ради	Отенко Ірина Павлівна
Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні	Отенко Ірина Павлівна
Відповідальний за підготовку облікових документів	Близнюк Т. П.
Реєстратор	УкрІНТЕІ

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності

Юрченко Тетяна Анатоліївна