

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д 26.001.48

Повне найменування юридичної особи: Київський національний університет імені Тараса Шевченка

Код за ЄДРПОУ: 02070944

Місцезнаходження: вул. Володимирська, 60, м. Київ, Київська обл., 01033, 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: 01033, м. Київ, вул. Володимирська, 64

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.35.51

Тема дисертації:

1. Моделювання та прогнозування кризи платіжного балансу в Україні .
2. Modeling and forecasting the Balance of Payments crisis in Ukraine.

Реферат:

1. У дисертаційній роботі проведений системний аналіз підходів до моделювання кризи платіжного балансу, виконано моделювання кризи платіжного балансу та її прогнозування для України на основі сигнального та модельного підходів. У дослідженні здійснений аналіз еволюції кризи, вивчені форми, в яких вона може проявлятися, основні канали її поширення, що є актуальними на сьогодні. У дослідженні розглянуті основні методи прогнозування кризи: економетричні моделі, факторний аналіз та сигнальний підхід. Вивчені переваги та недоліки кожного з зазначених методів, досвід їх використання на основі країн, що розвиваються. В роботі розроблена економіко-математична модель прогнозування кризи платіжного балансу та система індикаторів попередження кризи. Індикатори, отримані на основі економетричної моделі, співпадають зі змінними, які визначені на основі сигнального підходу, що підтверджує консистентність оцінок. Розроблені підходи дозволяють зробити прогноз виникнення кризи платіжного

балансу на наступні 12 місяців: консистентність оцінок підтверджена результатами прогнозування на даних 2013-го року. Оцінений вплив девальвації на зовнішню торгівлю в Україні та для країн, що подолали наслідки кризи платіжного балансу.

2. Paper pointed out the main theoretical concepts of the Balance of Payments crisis, the evolution of the Balance of Payments crisis models from "Generation I" to "Generation III" model as well as hidden and untypical forms of crisis. The contagion effect of the Balance of Payments crisis is researched. Diversity of approaches to the Balance of Payments crisis modeling based on the worldwide expertise studied. Particular emphasis has been placed on signal approach, econometrics tools and factor analysis. The exchange market pressure index was chosen as a measure of the Balance of Payments crisis. It designates the Balance of Payments crisis and consists of weighted sum of changes in international reserves, exchange rate and interest rate. The estimation and analysis is based on econometrics models and signal approach, which both allow to predict the Balance of Payments crisis. Both methods pointed out similar indicators that inform about an upcoming crisis: current account deficit to GDP, core inflation, loans to GDP ratio, CRU index, EMBI index, impact of trading partners' Balance of Payments crisis etc. Crisis warning threshold is defined for each indicator. Aggregated warning index for signaling of upcoming crisis has been calculated. It is based on selected variables by signal approach and shows increasing risk of crisis in case of crossing threshold by majority of indicators. The main channels of spreading the Balance of Payments crisis are defined as well as main indicators signaling that country is at risk of the crisis are designated. The share of international trade to GDP, the level how imports exceeds exports, availability of substitutes for imported goods and competitiveness of exports, diversity of international borrowings proves that Ukraine is in a risk zone of the Balance of Payments crisis. External stability maps are built, and allow graphically illustrates how large external imbalances are and pointed out tendency of their growth. The procedure of response function estimation on one standard deviation shock is based on VAR models. It allows to measure impact of the one standard deviation shock of changes in exchange rate, GDP growth and CRU steel index on changes in exports and imports. These estimations are made based on Ukrainian data, as well as on pool data of emerging countries that experienced the Balance of Payments crisis. Mentioned above tools were used to out-sample forecast of the Balance of Payments crisis for 2013 year. Results of estimation based on signal approach and econometrics models are in line with calculated values of the exchange market pressure index for 2013. It proves effectiveness of the proposed tools that allowed to highlight increasing external imbalances leading to the upcoming crisis in 2014. The importance of taking into consideration political turbulences is analyzed. It is proved in the paper that political crisis usually becomes a trigger of the Balance of Payments crisis in a country with open economy and accumulated external imbalances. The system of the indicators and tools proposed in the paper signals about an upcoming crisis and can be used for preventing unexpected crisis shocks and minimizing its negative impact.

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 ОПВ:

Впровадження результатів дисертації:

Зв'язок з науковими темами:

VI. Відомості про наукового керівника/керівників (консультанта)

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Черняк Олександр Іванович
2. Chernyak Oleksandr Ivanovych

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.11

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. Лук'яненко Ірина Григорівна
2. Лук'яненко Ірина Григорівна

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.11

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. Гур'янова Лідія Семенівна
2. Гур'янова Лідія Семенівна

Кваліфікація: к.е.н., 08.00.11

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**

Затонацька Тетяна Георгіївна

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові
головуючого на засіданні**

Затонацька Тетяна Георгіївна

**Відповідальний за підготовку
облікових документів**

Реєстратор

**Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є
відповідальним за реєстрацію наукової
діяльності**



Юрченко Т.А.