# Облікова картка дисертації

## I. Загальні відомості

**Державний обліковий номер:** 0407U004053

**Особливі позначки:** відкрита

**Дата реєстрації:** 26-10-2007

**Статус:** Захищена

**Реквізити наказу МОН / наказу закладу:**

## II. Відомості про здобувача

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові:**

1. Колот Олена Анатоліївна
2. Kolot Olena Anatolijvna

**Кваліфікація:**

**Ідентифікатор ORCHID ID:** Не застосовується

**Вид дисертації:** кандидат наук

**Аспірантура/Докторантура:** ні

**Шифр наукової спеціальності:** 08.00.08

**Назва наукової спеціальності:** Гроші, фінанси і кредит

**Галузь / галузі знань:** Не застосовується

**Освітньо-наукова програма зі спеціальності:** Не застосовується

**Дата захисту:** 12-10-2007

**Спеціальність за освітою:** 7.050104

**Місце роботи здобувача:** Товариство з обмеженою відповідальністю „АртА цінні папери”

**Код за ЄДРПОУ:** 32709075

**Місцезнаходження:** 01001, м. Київ, пров. Музейний, 4

**Форма власності:**

**Сфера управління:**

**Ідентифікатор ROR:** Не застосовується

## III. Відомості про організацію, де відбувся захист

**Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради):** Д 27.855.01

**Повне найменування юридичної особи:** Університет державної фіскальної служби України

**Код за ЄДРПОУ:** 40233365

**Місцезнаходження:** вул. Університетська, 31, м. Ірпінь, Київська обл., 08205, Україна

**Форма власності:**

**Сфера управління:** Державна фіскальна служба України

**Ідентифікатор ROR:** Не застосовується

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

**Повне найменування юридичної особи:** Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана

**Код за ЄДРПОУ:** 02070884

**Місцезнаходження:** м.Київ,просп. Перемоги, 54/1

**Форма власності:**

**Сфера управління:** Міністерство освіти України

**Ідентифікатор ROR:** Не застосовується

## V. Відомості про дисертацію

**Мова дисертації:**

**Коди тематичних рубрик:** 06.73.07

### Тема дисертації:

1. Борговий портфель держави: управління ризиками та оптимізація структури
2. Debt portfolio of state: risks management and structure optimization

### Реферат:

1. Об'єкт дослідження: управління борговим портфелем держави в умовах ризику. Мета дослідження: наукове обґрунтування теоретико-методологічних і прикладних аспектів державного боргового ризик-менеджменту, узагальнення та адаптування до українських реалій світового досвіду теорії й практики управління ризиками боргового портфеля держави. Методи дослідження: діалектики, аналізу і синтезу; класифікації та типології; системного підходу; факторний та кореляційний аналіз; економіко-математичне моделювання; статистичне моделювання, порівняльний аналіз.. Теоретичні і практичні результати: полягають в обґрунтуванні цілісної концептуально-теоретичної бази управління ризиками боргового портфеля держави та оптимізації його структури, а також у виробленні рекомендацій щодо становлення системи державного боргового ризик-менеджменту в Україні. Новітність нововпроваджуваного: вперше розроблено класифікацію ризиків боргового портфеля держави з їх поділом на ризики макро- та мікрорівня; запроваджено в науковий понятійнийапарат дефініцію „контролінг ризиків у сфері боргових запозичень

держави”; запропоновано імітаційну модель структури боргового портфеля уряду України. Удосконалено: визначення дефініції „борговий портфель держави”; теоретичні засади прояву та впливу ризиків макроекономічного, макрофінансового та ринкового характеру; визначення основних етапів та складових боргового ризик-менеджменту; систематизацію підходів до оцінки ризиків боргового портфеля; підходи до оцінки боргової стійкості держави. Набуло подальшого розвитку: питання інституціонального забезпечення процесу управління борговим портфелем держави та ризиками; методичний підхід до розробки стратегічного портфельного стандарту. Ступінь упровадження. пропозиції та рекомендації, що стосуються оптимізації структури боргових зобов’язань уряду України та побудови сучасної комплексної системи боргового ризик-менеджменту, використовуються Міністерством фінансів України (довідка про впровадження № 23050-10 від 05.04.06 р.); Міністерством економіки України (довідкапро впровадження № 14-48/9 від 17.01.07 р.); Радою національної безпеки і оборони України (довідка про впровадження № 6/9-134-6-5 від 19.01.07 р.); в навчальному процесі Київського національного економічного університету імені Вадима Гетьмана ( довідка про впровадження від 14.11.06 р.). Сфера використання: основні положення роботи можуть бути використані як методологічна база для розробки державного боргового ризик-менеджменту в Україні

2. Object of study: state debt portfolio management in risk conditions. Purpose of study: scientific substantiation of theoretical, methodological, and applied aspects of state debt risk management, generalization of the world experience of theory and practice of state debt portfolio risk management and its adaptation to Ukrainian realities. Methods of study: dialectics, analysis, and synthesis; classification and typology; systemic approach; factorial and correlation analysis; economic and mathematical modeling; statistical modeling; comparative analysis. Theoretical and practical results: substantiation of integral conceptual theoretical base of the state debt portfolio risk management and optimization of its structure, and also development of recommendations concerning creation of the state debt risk management system in Ukraine. Scientific novelty of the study results: classification of risks of the state debt portfolio with their division into the macro- and micro-level risks was developed for the first time; definition of "risk controlling in sphere of the state debt borrowings" was introduced into scientific notional apparatus; imitational model of the structure of Ukrainian government debt portfolio was proposed. The following was improved: definition of "the state debt portfolio"; theoretical principles of manifestation and effect of risks of macroeconomic, macro-financial, and market management; determination of main phases and components of debt risk management; conceptual approaches to its implementation within the framework of macroeconomic management and on the level of structure of the state debt portfolio; systematization of approaches to the assessment of debt portfolio risks; approaches to the assessment of debt-related stability of the state. Further developed were: issues of institutional provision of the process of management of the state debt portfolio and the risks which affect it; methodological approach to the development of strategic portfolio standard. Degree of implementation: proposals and recommendations which concern optimization of the structure of debt obligations of Ukrainian government and creation of modern complex system of debt risk management are used by the Ministry of Finances of Ukraine (certificate of implementation No. 23050-10 dated 05.04.06); Ministry of Economy of Ukraine (certificate of implementation No. 14-48/9 dated 17.01.07); Council of National Security and Defense of Ukraine (certificate of implementation No. 6/9-134-6-5 dated 19.01.07). Certain provisions and conclusions of the dissertation work are used during educational process at Vadym Hetman Kyiv National University of Economics (certificate of implementation dated 14.11.06). Sphere of use: Main results of the dissertation study may be used both as methodical elaborations and practical recommendations to set up the process of assessment and management of the state debt portfolio risks, to develop institutional and legislative principles of the state debt management in Ukraine, and form the strategy andtactics of the scientifically substantiated debt policy concerning both new borrowings and existing liabilities. Results of the study may also be used during development of the relevant study courses in institutions of higher education.

**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. Федосов В.М.
2. Fedosov V.M.

**Кваліфікація:** 08.00.08

**Ідентифікатор ORCHID 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. Барановский О.І.
2. Барановский О.І.

**Кваліфікація:** 08.00.08

**Ідентифікатор ORCHID 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. Кравчук Н.Я.
2. Кравчук Н.Я.

**Кваліфікація:** 08.00.08

**Ідентифікатор ORCHID 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** | Андрущенко В.Л. |
| **Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні** | Андрущенко В.Л. |
| **Відповідальний за підготовку облікових документів** | |
| **Реєстратор** | |
| **Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності** | Юрченко Т.А. |