# Облікова картка дисертації

## I. Загальні відомості

**Державний обліковий номер:** 0424U000074

**Особливі позначки:** відкрита

**Дата реєстрації:** 04-04-2024

**Статус:** Захищена

**Реквізити наказу МОН / наказу закладу:**

## II. Відомості про здобувача

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові:**

1. Благун Семен Іванович
2. Semen I. Blahun

**Кваліфікація:**

**Ідентифікатор ORCHID ID:** 0000000282448794

**Вид дисертації:** кандидат наук

**Шифр наукової спеціальності:** 08.00.11

**Назва наукової спеціальності:** Математичні методи, моделі та інформаційні технології в економіці

**Галузь / галузі знань:** Не застосовується

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

**Дата захисту:** 19-04-2024

**Спеціальність за освітою:** 8.03050201 економічна кібернетика

**Місце роботи здобувача:** Прикарпатський національний університет імені Василя Стефаника

**Код за ЄДРПОУ:** 02125266

**Місцезнаходження:** вул. Шевченка, буд. 57, Івано-Франківськ, 76018, Україна

**Форма власності:** Державна

**Сфера управління:** Міністерство освіти і науки України

**Ідентифікатор ROR:**

**Сектор науки:** Університетський

## III. Відомості про дисертацію

**Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради):** Д 70.052.02

**Повне найменування юридичної особи:** Хмельницький національний університет

**Код за ЄДРПОУ:** 02071234

**Місцезнаходження:** вул. Інститутська, буд. 11, Хмельницький, Хмельницький р-н., 29016, Україна

**Форма власності:** Державна

**Сфера управління:** Міністерство освіти і науки України

**Ідентифікатор ROR:**

**Сектор науки:** Університетський

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

**Повне найменування юридичної особи:** Прикарпатський національний університет імені Василя Стефаника

**Код за ЄДРПОУ:** 02125266

**Місцезнаходження:** вул. Шевченка, буд. 57, Івано-Франківськ, 76018, Україна

**Форма власності:** Державна

**Сфера управління:** Міністерство освіти і науки України

**Ідентифікатор ROR:**

**Сектор науки:** Університетський

## V. Відомості про дисертацію

**Мова дисертації:** Українська

**Коди тематичних рубрик:** 06.73.55, 06.01.30

**Тема дисертації:**

1. Моделювання дифузії фінансових інновацій і стійкості банківського сектору України
2. Modelling the diffusion of financial innovations in the banking sector of Ukraine

**Реферат:**

1. Благун С. І. Моделювання дифузії фінансових інновацій і стійкості банківського сектору України. – Кваліфікаційна наукова праця на правах рукопису. Дисертація на здобуття наукового ступеня кандидата економічних наук зі спеціальності 08.00.11 – математичні методи, моделі та інформаційні технології в економіці. – Хмельницький національний університет. – Хмельницький, 2024. Дисертацію присвячено розробці теоретико-методичного забезпечення моделювання дифузії фінансових інновацій і стійкості банківського сектору України. Запропоновано науково-методичний підхід до моделювання впливу глобальних фондових ринків на локальний ринок України на основі гіпотези адаптивного ринку з використанням низки тестів (Грейнджера, Дікі-Фуллера, Філіпса-Перрона) і адаптивної системи висновків

(ANFIS), яка заснована на нечіткій системі висновків Такагі-Сугено. Розроблено методичний підхід до побудови комплексного показника оцінки стійкості банківської системи України, який передбачає факторний аналіз методом головних компонент і використання моделі нечіткого висновку Мамдані. За допомогою моделі авторегресійної умовної гетероскедастичності (ARCH) підтверджено гіпотезу про вплив фактору екзогенної дифузії фінансових інновацій на доходність державних облігацій учасників фондового ринку. За допомогою сімейства моделей (ARCH, GARCH, ARCH-M) доведено гіпотезу про вплив фінансових інновацій на обмінний курс двох основних закордонних валют, а саме: євро та долар США. Уточнено сутність поняття «інновації», яке має багатоваріантність, є довільним і залежить від передумов для створення нових теорій і може буди 19 будь-яким у відповідності до конкретного завдання. Здійснено класифікацію інновацій за такими ознаками прояву у процесі: цілепокладання, ступеня проникнення, спрямованості, характеристики. Здійснено класифікацію факторів, які впливають на фінансову стійкість банків та банківської системи, яка включає внутрішні фактори (фінансовоекономічні, організаційні, технологічні, комерційні); зовнішні фактори (загальноекономічні, фінансові, політичні, правові, соціально-психологічні, форс-мажорні, глобалізаційні). Ключові слова: моделювання дифузії, інновації, фінансові інновації, дифузія фінансових інновацій, банківський сектор.

2. Blahun S. I. Modelling the diffusion of financial innovations in the banking sector of Ukraine. – Qualifying scientific work on the rights of the manuscript. A thesis on a Candidate of Economics degree by specialty 08.00.11 – mathematical methods, models and information technologies in economics. – Khmelnytskyi National University. – Khmelnytskyi, 2024. The dissertation is devoted to the development of theoretical and methodological support for modeling the diffusion of financial innovations and sustainability of the banking sector of Ukraine. A methodical approach to modeling the influence of global stock markets on the local market of Ukraine on the basis of the adaptive market hypothesis using a number of tests (Granger, Dickey-Fuller, Phillips-Perron) and the adaptive inference system (ANFIS), which is based on the fuzzy system of conclusions of Takagi-Sugueno, has been proposed. A methodical approach to building a comprehensive indicator for assessing the stability of the banking system of Ukraine has been developed, which provides for factor analysis by the principal components method and the use of the Mamdani fuzzy inference model. With the help of the model of autoregression conditional heteroscedasticity (ARCH), the hypothesis about the influence of the factor of exogenous diffusion of financial innovations on the yield of government bonds of stock market participants is confirmed. A test of the adaptive market hypothesis using the Takagi-Sugeno fuzzy inference model revealed the impact of the FTSE350 and S&P500 indices on the PFTS index and indicates sufficiently well-defined system parameters of the fuzzy inference model. The behavior of the daily profitability indicators of the global stock indices S&P500, FTSE350, DAX, as well as the local PFTS index, showed that calendar anomalies, which are proof of the efficient market hypothesis, were not detected, and the obtained results partially confirm the adaptive market hypothesis. With the help of a family of models (ARCH, GARCH, ARCH-M), the hypothesis about the influence of financial innovations on the exchange rate of two major foreign currencies, namely the euro and the US dollar, has been proved. 20 The essence of the concept of «innovation», which has multivariance, is arbitrary and depends on the prerequisites for the creation of new theories and can be any in accordance with a specific task, has been clarified. The classification of innovations according to the following signs of manifestation in the process is carried out: goal setting, degree of penetration, directionality, characteristics. A classification of factors influencing the financial stability of banks and the banking system has been carried out, which includes internal factors (financial, economic, organizational, technological, commercial); external factors (general economic, financial, political, legal, socio-psychological, force majeure, globalization). Key words: diffusion modeling, innovations, financial innovations, diffusion of the financial innovations banking sector

**Державний реєстраційний номер ДіР:** 0113U005083

**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:** Розвиток сучасних інформаційних, комунікаційних технологій, робототехніки

**Підсумки дослідження:** Теоретичне узагальнення і вирішення важливої наукової проблеми

**Публікації:**

- 1. Благун С. І. Аналіз підходів до оцінки стійкості банківської системи України. Бізнес Інформ. 2023. № 3. С. 130□144. DOI: 10.32983/2222-4459-2023-3-130-144. (Index Copernicus, Ulrichsweb Global Serials Directory, DOAJ, OAJI, WorldCat та ін.) (0,63 друк. арк.).
- 2. Благун С. І. Аналіз тенденцій розвитку грошово-кредитної системи України. Проблеми економіки. 2023. № 1. С. 170□184. DOI: 10.32983/2222-0712-2023-1-170-184. (RePEc, EBSCO, Index Copernicus, Ulrichsweb Global Serials Directory, DOAJ, OAJI, WorldCat та ін.) (0,59 друк. арк.).
- 3. Благун С. І. Визначення місця фінансових інновацій у процесі розвитку фінансового ринку. Наукові інновації та передові технології. 2022. № 12 (14). С. 118□128. DOI: 10.52058/2786-5274-2022-12(14)-118-127 (Index Copernicus, ResearchBib та ін.) (0,4 друк. арк.).
- 4. Благун С. І. Еволюція розвитку інноваційних моделей. Український журнал прикладної економіки та техніки. 2021. № 4. С. 59□66. DOI: 10.36887/2415-8453-2021-4-8. (Index Copernicus, WorldCat, ResearchBib та ін.) (0,3 друк. арк.).
- 5. Благун С. І. Дослідження впливу фінансових інновацій на основні фінансові показники України. Бізнес Інформ. 2021. № 12. С. 108–113. DOI:10.32983/2222-4459-2021-12-108-113 (Index Copernicus, Ulrichsweb Global Serials Directory, DOAJ, OAJI, WorldCat та ін.) (0,3 друк. арк.).
- 6. Благун С. І. Фінансові інновації як елемент фінансової системи. Вісник Хмельницького національного університету. 2021. № 6. Т. 2. С. 152□157. DOI: 10.31891/2307-5740-2021-300-6/2-25 (Index Copernicus) (0,4 друк. арк.).
- 7. Благун С. І. Ідентифікація фінансової системи в економіці держави. Вісник Чернівецького торговельно-економічного інституту. Економічні науки. 2016. Вип. 1. С. 151□156. URL: http://nbuv.gov.ua/UJRN/Vchtei_2016_1_18 (0,35 друк. арк.).
- 8. Благун С. І. Аналіз моделей дифузійних процесів інновацій на фінансових ринках. Моделювання регіональної економіки. 2015. № 2 (26). С. 34□41 (0,3 друк. арк.).
- 9. Blahun I. S., Dmytryshyn L. I., Blahun, I. I., Blahun, S. I. Stock indices as indicators of market efficiency and interaction. Ikonomicheski Izsledvania. 2022, 31 (8), 87–106 (Scopus, RePEc, EBSCO та ін.) (1,1 друк. арк.). Особистий внесок: доведено вплив глобальних ринків на економіку країни (0,35 друк. арк.).
- 10. Blahun, I. S., Blahun, I. I., Blahun, S. I. Assessing the stability of the banking system based on fuzzy logic methods. Banks and Bank Systems. 2020, 15 (3), 171□183. DOI:10.21511/bbs.15(3). 2020.15 (Scopus, EconBiz, ERIH PLUS, DOAJ, Academic Recource Index та ін.) (0,97 друк. арк.). Особистий внесок: складено класифікацію факторів, які впливають на фінансову стійкість банків і банківської системи (0,3 друк. арк.).
- 11. Дмитришин Л. І., Благун С. І. Генезис підходів до ідентифікації фінансових інновацій // Моделирование поведения хозяйствующих субъектов в условиях изменяющейся рыночной среды: кол. моногр. ; под ред. д-р экон. наук, проф. В. С. Пономаренко, д-р экон. наук, проф. Т. С. Клебановой. Бердянск: издатель Ткачук А. В. 2016. С. 128–138. URL: https://mpsesm.org/downloads/ mono_2016.pdf (0,5 друк. арк.). Особистий внесок: уточнено сутність поняття «інновації», яке має багатоваріантність тлумачення, постає довільним і залежить від передумов щодо створення нових теорій (0,25 друк. арк.).
- 12. Благун С. І. Дослідження процесних інновацій в фінансовому секторі / Proceedings of the 5th International Scientific and Practical Internet Conference «Integration of Education, Science and Business in Modern Environment: Summer Debates». Dnipro, Ukraine, August 3–4, 2023. P. 117–118 (0,15 друк. арк.).
- 13. Благун С. І. Напрямки дослідження фінансових інновацій. Матеріали міжнародної науково-практичної конференції «Стратегічні орієнтири розвитку економіки, обліку, фінансів та права».

Кременчук, 30 серп. 2023 р. С. 40–41 (0,2 друк. арк.).

- 14. Дмитришин Л., Благун С. Моделювання процесу інноваційної діяльності на ринку фінансових послуг // Матеріали Міжнародної науково-практичної конференції «Моделювання соціально-економічних процесів: регіональні та галузеві аспекти». Дрогобич, 12□15 трав. 2016. С. 21□24 (0,25 друк. арк.). Особистий внесок: розглянуто складові процесу інноваційної діяльності (0,15 друк. арк.).
- 15. Благун С. І. Особливості моделювання інноваційних процесів // Матеріали VII Міжнародної науково-методичної конференції «Форум молодих економістів-кібернетиків. Моделювання економіки: проблеми, тенденції, досвід». Тернопіль, 21□22 жовт. 2016. С. 121□123 (0,2 друк. арк.).

**Наукова (науково-технічна) продукція:** методи, теорії, гіпотези; методичні документи; програмні продукти, програмно-технологічна документація; аналітичні матеріали

**Соціально-економічна спрямованість:** підвищення автоматизації виробничих процесів; забезпечення промисловості чи населення новим видом інформаційно-комунікаційних послуг

**Охоронні документи на ОПІВ:**

**Впровадження результатів дисертації:** Впроваджено

**Зв'язок з науковими темами:** 0113U005083

## VI. Відомості про наукового керівника/керівників (консультанта)

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові:**

1. Дмитришин Леся Ігорівна

2. Lesia I. Dmytryshyn

**Кваліфікація:** д. е. н., професор

**Ідентифікатор ORCHID ID:** Не застосовується

**Додаткова інформація:**

**Повне найменування юридичної особи:** Прикарпатський національний університет імені Василя Стефаника

**Код за ЄДРПОУ:** 02125266

**Місцезнаходження:** вул. Шевченка, буд. 57, Івано-Франківськ, 76018, Україна

**Форма власності:** Державна

**Сфера управління:** Міністерство освіти і науки України

**Ідентифікатор ROR:**

**Сектор науки:** Університетський

## VII. Відомості про офіційних опонентів та рецензентів

**Офіційні опоненти**

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові:**

1. Ляшенко Олена Ігорівна

2. Olena I. Liashenko

**Кваліфікація:** д.е.н., професор

**Ідентифікатор ORCHID ID:** Не застосовується

**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:**

**Сектор науки:** Університетський

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові:**

1. Койбічук Віталія Василівна

2. Vitaliia V. Koibichuk

**Кваліфікація:** к. е. н., доцент

**Ідентифікатор ORCHID ID:** 0000-0002-3540-7922

**Додаткова інформація:**

**Повне найменування юридичної особи:** Сумський державний університет

**Код за ЄДРПОУ:** 05408289

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

**Форма власності:** Державна

**Сфера управління:** Міністерство освіти і науки України

**Ідентифікатор ROR:**

**Сектор науки:** Університетський

**Рецензенти**

## VIII. Заключні відомості

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові голови ради** Нижник Віктор Михайлович

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

**Відповідальний за підготовку облікових документів**

Гончар О.І.

**Реєстратор**

УкрІНТЕІ

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

Юрченко Тетяна Анатоліївна