Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0417U001536

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 03-04-2017

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Крицун Катерина Ігорівна
2. Krytsun Kateruna Igorivna

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: так

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: 06-03-2016

Спеціальність за освітою: 8.03050201

Місце роботи здобувача: 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

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. Економіко-математичне моделювання динаміки фінансових індикаторів.

2. Economic mathematical modeling dynamics of the financial indicators.

Реферат/анотація:

1. У дисертаційній роботі проведено аналіз динаміки фінансових індикаторів фондових ринків та валютної пари євро/долар. Здійснено моніторинг ситуації на польському фондовому ринку на різних часових вікнах: у період зростання, кризи та після кризовий період. У дослідженні розглянуті основні методи моделювання динаміки фінансових індикаторів, підходи до аналізу фінансових часових рядів. Розроблено комплекс економіко-математичних моделей динаміки фінансових індикаторів на основі теоретичних та практичних положень та методів дослідження фінансових часових рядів. Використано нелінійний та економетричний інструментарій, розроблено концептуальну схему використання цього комплексу моделей. Розроблений комплекс моделей дозволяє здійснювати моніторинг стану фінансового ринку, моделювати волатильність часових рядів в умовах його стабільного функціонування та виявляти силу впливу збурень між валютною парою та фондовим ринком. Запропоновані рекомендації дозволять відновити розвиток та зростання

фондового ринку України.

2. The research highlights main macroeconomic factors that influence on financial indicators. Author proposes meaning of the term 'financial indicators'. It analyzes the dynamics of financial indicators of the stock markets and foreign exchange market, carried out monitoring of the situation on the market in different time windows: in a period of growth, crisis and after the crisis with using multifractal analysis of detrended fluctuations. The study describes the main methods of modeling the dynamics of financial indicators, approaches to the analysis of financial time series. The advantages and disadvantages of each of these methods. It shows main purposes and definitions of fractal and multifractal analysis. Also confirms fractal market hypothesis on real data. Using R/S analysis gave the results that highlight financial indicators such as stock index as persistent time series. It means that dynamics will continue it's behavior for some period of time in the future. But if look at exchange rate pair that is analyzed by R/S analysis, the results shows that this pair is Brownian motion. The investigation proposes econometric models such as EGARCH, VAR. Using EGARCH-model will help predict volatility of stock index in stable period in the stock market. VAR modelling is used to find out how shocks of WIG stock index causes shocks in Euro/Dollar dynamics. That can influence on future forecast. The thesis describes a complex mathematical economic models and conceptual framework of the proposed complex, which can be used by the government in the formation of state policy, investment institutions and individual investors for the formation of an investment portfolio and market traders to select the investment strategy.

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. Ляшенко Олена Ігорівна

2. Lyashenko Olena Igorivna

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

VII. Відомості про офіційних опонентів та рецензентів

Офіційні опоненти

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Максишко Наталія Костянтинівна
2. Максишко Наталія Костянтинівна

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. Буртняк Іван Володимирович
2. Буртняк Іван Володимирович

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	Черняк Олександр Іванович
Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні	Черняк Олександр Іванович
Відповідальний за підготовку облікових документів	
Реєстратор	
Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності	Юрченко Т.А.