

Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0405U001921

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 17-05-2005

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:



II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Абед Саїф Ахмед Аль-Гулі
2. Abed Saif Ahmed Al-Ghawli

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: так

Шифр наукової спеціальності: 05.13.06

Назва наукової спеціальності: Інформаційні технології

Галузь / галузі знань: Не застосовується

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 13-04-2005

Спеціальність за освітою: 8.091501

Місце роботи здобувача: Харківський національний університет радіоелектроніки

Код за ЄДРПОУ: 02071197

Місцезнаходження: 61166, м. Харків, пр. Науки, 14

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 64.052.01

Повне найменування юридичної особи: Харківський національний університет радіоелектроніки

Код за ЄДРПОУ: 02071197

Місцезнаходження: проспект Науки, 14, м. Харків, Харківський р-н., Харківська обл., 61166, 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: Харківський національний університет радіоелектроніки

Код за ЄДРПОУ: 02071197

Місцезнаходження: 61166, м. Харків, пр. Науки, 14

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 50.51.15

Тема дисертації:

1. Математичні моделі прогнозування динамічних рядів у дилінгових інформаційних системах
2. Mathematical Models of Dynamic Series Forecasting in Dealing Information Systems

Реферат:

1. Робота присвячена розробці елементів математичного забезпечення дилінгових інформаційних систем, що реалізують процедуру побудови моделей прогнозування на основі аналізу статистичних властивостей динамічних рядів. Удосконалено послідовну процедуру побудови багатовимірних моделей тренда для стохастичних часо-вих рядів курсу валют за фундаментальним фактором, у частині коректного використання робастних і зміщених методів оцінювання. Вперше отримані математичні моделі прогнозування динамічних рядів з урахуванням передбаченої помилки прогнозу. Математична модель прогнозування помилки прогнозу синтезується на базі досліджень методів експонентного згладжування та їхніх модифікацій, авторегресії і проінтегрованого ковзного середнього в умовах впливу збурюючих факторів, що дозволило підвищити якість моделі прогнозування. Вперше отримані математичні моделі прогнозування курсу валют для зростаючих і подавальних частин часового ряду за допомогою НС, що разом з результатами технічного аналізу зменшили величину ринкових ризиків. Наукові результати знаходять практичне застосування при розробці математичного забезпечення АСУ.

2. The Thesis is dedicated to elaboration of elements of mathematical software for dealing information systems realizing the procedure of forecasting models construction based on analysis of statistic properties of dynamic series. Consecutive procedure for multi-dimensional models of trend building for stochastic temporary series of foreign currency exchange rates has been improved based on fundamental factors, in particular, correct using of robust and shifted methods of estimation. For the first time, mathematical models of dynamic series forecasting with the consideration of the error forecasting have been developed. Mathematical forecasting model of a forecast error has been synthesized based on the research of exponential alignment methods and their modification of autoregress and integrated sliding mean under conditions of the impact of disturbing factors that allowed to increase the quality of forecasting models. For the first time, mathematical forecasting models have been obtained for foreign exchange currency rates for increasing and declining portions of the temporary series with the assistance of NN, which together with the results of the technical analysis decreased the value of market risks. Scientific results can be applied when developing mathematical software for ACS.

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. Шамша Б.В.
2. Shamsha B.V.

Кваліфікація: к.т.н., 05.13.01

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. Федорович О.Є.
2. Федорович О.Є.

Кваліфікація: д.т.н., 05.13.06

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. Євсєєв В.В.
2. Євсєєв В.В.

Кваліфікація: к.т.н., 05.13.01

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**

Бондаренко М.Ф.

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

Бондаренко М.Ф.

**Відповідальний за підготовку
облікових документів**

Реєстратор

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



Юрченко Т.А.