Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0412U002994

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 21-06-2012

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Дмитрусенко Костянтин Олегович
2. Dmytrusenko Kostiantyn Olegovych

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: 07-06-2012

Спеціальність за освітою: 8.050102

Місце роботи здобувача: Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця

Код за ЄДРПОУ: 02071211

Місцезнаходження: 61166, м. Харків, проспект Науки, 9 а

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 64.055.01

Повне найменування юридичної особи: Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця

Код за ЄДРПОУ: 02071211

Місцезнаходження: проспект Науки, 9-А, 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 економічний університет імені Семена Кузнеця

Код за ЄДРПОУ: 02071211

Місцезнаходження: 61166, м. Харків, проспект Науки, 9 а

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 взаємодії складових фінансового ринку України

2. Modelling of the Ukrainian financial market components interaction

Реферат/анотація:

1. Об'єкт дослідження: процес взаємодії складових фінансового ринку України; мета роботи: подальший розвиток теоретичних положень щодо моделювання взаємодії складових фінансового ринку України, побудова комплексу моделей аналізу і прогнозування цієї взаємодії; методи дослідження та апаратура: методи логічного та монографічного аналізу, метод Херста, методи вейвлет-аналізу, математичний апарат векторних авторегресійних моделей і моделей корекції помилки, методи дослідження коінтеграці методи дисперсійного аналізу; теоретичні і практичні результати: концептуальна модель аналізу та прогнозування взаємодії складових фінансового ринку України, що, на відміну від існуючих, побудована на основі використання методів вейвлет-розкладання, VAR- і VEC- моделей та дає можливість суб'єктам інвестиційної діяльності приймати більш обґрунтовані управлінські рішення; методичний підхід до побудови моделей короткострокового прогнозування показників функціонування складових фінансового ринку України, що

завдяки розкладанню динамічних рядів засобами вейвлет-аналізу, суттєво підвищує якість отриманих прогнозних значень; комплекс моделей розкладання часових рядів показників функціонування складових фінансового ринку України, який, на відміну від існуючих, розроблений на основі використання сучасних методів вейвлет-розкладання сигналу та спрямований на побудову якісних прогнозів з різними горизонтами прогнозування; комплекс моделей взаємодії складових фінансового ринку України, що, на відміну від існуючих, побудований на основі поєднання апарату векторних авторегресійних моделей і моделей корекції помилки та надає можливість визначити ступінь впливу між цими складовими; алгоритмічна модель коригування короткострокових прогнозів показників функціонування складових фінансового ринку України, що, на відміну від існуючих, базується на врахуванні результатів декомпозиції дисперсії цих показників і дозволяє поліпшити якість прогнозів; ступінь упровадження: розробки впроваджені в практичну діяльність приватного акціонерного товариства "Фінпрофіль", ТОВ "Східно-кримська фондова компанія", приватного акціонерного товариства "Фінансова компанія "Ваш вибір"; сфера використання: моделювання взаємодії складових фінансового ринку України

2. Object of research: the interaction of the; objective: further development of theoretical propositions concerning the modelling of the Ukrainian financial market components interaction, the construction of the complex models of this interaction analysis and prediction; methods: the methods of logical and monographic analysis, the Hurst method, the methods of wavelet analysis, vector autoregressive models and error correction models, cointegration methods, methods of variance analysis; theoretical and practical results: a conceptual model of the Ukrainian financial market components interaction analysis and prediction, which, unlike the existing ones, is based on the using of wavelet decomposition methods, VAR-, VEC-models and allows the investment activity subjects to make more reasonable management decisions; methodical approach to building short-term forecasting models of the Ukrainian financial market components indicators, which, due to the decomposition of time series by means of wavelet analysis significantly increases the quality of the predicted values; complex of models of the Ukrainian financial market components indicators dynamics decomposition, which, unlike the existing ones, designed using the wavelet decomposition methods and is aimed at building a high-quality forecasts at different horizons of forecasting; complex models of the Ukrainian financial market components interaction, which, unlike the existing ones, is based on combining the vector autoregressive models and models of error correction and provides the ability to determine the degree of influence between these components; algorithmic model correcting short-term forecasts of the Ukrainian financial market components indicators, which, unlike the existing ones, based on the account of these indicators variance decomposition and helps to improve the forecasts quality; the degree of implementation: developing introduced into practice of the private joint-stock company "Finprofile", LLC "East-Crimean stock company", private company "Financial company "Your Choice "; the scope of use: modelling of the Ukrainian financial market components interaction.

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. Стрижиченко Костянтин Анатолійович
2. Stryzhychenko Kostiantyn Anatoliyovych

Кваліфікація: к.е.н., 08.03.02

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. Меркулова Тамара Вікторівна
2. Меркулова Тамара Вікторівна

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.01, 08.00.08

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. Куссий Михайло Юрійович
2. Куссий Михайло Юрійович

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