Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0416U003654

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 14-07-2016

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Луценко Олег Павлович
2. Lutsenko Oleh Pavlovych

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: 29-06-2016

Спеціальність за освітою: 8.05010301

Місце роботи здобувача: Дніпропетровський національний університет імені Олеся Гончара

Код за ЄДРПОУ: 02066747

Місцезнаходження: 49010, м. Дніпро, пр. Гагаріна 72

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): К 08.051.01

Повне найменування юридичної особи: Дніпровський національний університет імені Олеся Гончара

Код за ЄДРПОУ: 02066747

Місцезнаходження: проспект Гагаріна, 72, м. Дніпро, Дніпропетровський р-н., Дніпропетровська обл., 49010, 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: Дніпропетровський національний університет імені Олеся Гончара

Код за ЄДРПОУ: 02066747

Місцезнаходження: 49010, м. Дніпро, пр. Гагаріна 72

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.73.35

Тема дисертації:

1. Розробка інформаційної технології оцінки функцій ризику при біржовій торгівлі

2. The development of information technology for risk assessment in the process of exchange market trading

Реферат/анотація:

1. Об'єкт дослідження - процеси біржової торгівлі на ринку фінансів і цінних паперів. Предмет дослідження - математичні моделі функціонування ринку фінансів і цінних паперів та інформаційні технології оцінки функцій ризику за експериментальними даними. Мета роботи - розробка інформаційної технології для вдосконалення оцінки ризиків в процесі біржової торгівлі. Методи дослідження: B-сплайн апроксимація, методи виявлення розладнань, відтворення щільності розподілу. Вперше запропонована ймовірнісна модель аналізу біржового ринку, заснована на припущенні, що час появи розладнання в статистичних характеристиках ряду біржових котирувань є випадковою величиною, функція розподілу якої повільно змінюється в часі. На основі вказаної ймовірнісної моделі запропонований метод оцінки ризику виникнення розладнання на інтервалі часу в майбутньому для динамічних часових рядів з множинними розладнаннями.

Запропоновані обчислювальні схеми функцій ризику перевищення заданих рівнів цін в момент наступного розладнання при направленому ринковому тренді. Створено інформаційну технологію оцінки функцій ризику при біржовій торгівлі на базі запропонованих методів і обчислювальних схем. Практичне значення результатів дисертації підтверджене їхнім впровадженням у діяльність банківської установи ПАТ "АКБ "Конкорд", дослідницьку діяльність НДІ геології Дніпропетровського національного університету імені Олеся Гончара та навчальний процес. Галузь використання: фінансові установи.

2. The object of research is the exchange trading processes on the exchange market. The subject of research is mathematical models of exchange market operations and information technology risk assessment functions from experimental data. The purpose of work is the development of information technology to improve the risk assessment in trading. A probability model for the risk assessment for the exchange market, based on the assumption that the time of change-point occurence in stock exchange quotations is a random variable, a function of which changes slowly over time, has been proposed. On the basis of the mentioned model a calculation scheme for the risk of change-point occurence on the future time interval for the dynamic time series with multiple change-point has been proposed. Computational schemes for the risk of exceeding a price level at the vjvent of the next change-point was proposed. An information technology for risk assessment in stock exchange trading based on the proposed methods and computational schemes was developed. The practical significance of the obtained results is confirmed by their introduction into the work of the banking institution PAS "ACB "Concord" and into the teaching process. The area of usage: financial institutions.

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. Байбуз Олег Григорович

2. Oleg Bajbuz

Кваліфікація: д.т.н., 05.22.20

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. Мороз Борис Іванович
2. Мороз Борис Іванович

Кваліфікація: д.т.н., 05.25.05

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. Гнатушенко Вікторія Володимирівна
2. Гнатушенко Вікторія Володимирівна

Кваліфікація: к.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

Рецензенти

VIII. Заключні відомості

Власне Прізвище Ім'я По-батькові голови ради	Корчинський Володимир Михайлович
Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні	Корчинський Володимир Михайлович
Відповідальний за підготовку облікових документів	
Реєстратор	
Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності	Юрченко Т.А.