Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0421U102855

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 02-06-2021

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Безкоровайний Віталій Сергійович

2. Bezkorovainyi Vitalii Serhiiovych

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: 14-05-2021

Спеціальність за освітою: Економіка підприємства

Місце роботи здобувача: Державний вищий навчальний заклад "Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана"

Код за ЄДРПОУ: 02070884

Місцезнаходження: проспект Перемоги, буд. 54/1, м. Київ, 03057, Україна

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 26.006.07

Повне найменування юридичної особи: Державний вищий навчальний заклад "Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана"

Код за ЄДРПОУ: 02070884

Місцезнаходження: проспект Перемоги, буд. 54/1, м. Київ, 03057, 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: Державний вищий навчальний заклад "Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана"

Код за ЄДРПОУ: 02070884

Місцезнаходження: проспект Перемоги, буд. 54/1, м. Київ, 03057, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик:

Тема дисертації:

1. Моніторинг та прогнозування стану та динаміки валютного ринку
2. Monitoring and forecasting the state and dynamics of the foreign exchange market

Реферат/анотація:

1. Дисертація присвячена подальшому розвитку теоретичних засад та розробці інструментарію моніторингу стану та прогнозуванню динаміки валютного ринку. У дисертаційній роботі досліджено економічну сутність, особливості функціонування та перспективи розвитку валютного ринку в умовах цифрової трансформації. здійснено критичний аналіз методології та інструментарію прогнозування валютних курсів. Для задач прогнозування валютних котирувань та зміни їх напряму руху в роботі обґрунтовано застосування сучасних досягнень в галузі штучного інтелекту, зокрема, глибоких мереж різноманітної архітектури, перш за все згорткового та рекурентного типу, а також використання стекінгу цих мереж. В якості базових архітектур було використано згорткову мережу для виявлення ознак і конструювання предикторів, а для здійснення прогнозу – рекурентну нейронну мережу, яку реалізовано за допомогою моделі короткочасної довгої пам'яті та керованого рекурентного вентилю. Розроблені моделі глибокого навчання показали вищу точність

прогнозу порівняно з класичними методами прогнозування як для фіатних, так і для криптовалют.

2. The dissertation is devoted to the further development of theoretical bases and mathematical tools of monitoring the state of the foreign exchange market and forecasting the dynamics of currency quotes. The economic essence, features of functioning and prospects of development of the currency market in the conditions of digital transformation are investigated. The systematic analysis of the current state and prospects of the foreign exchange market shows that it is the largest segment of the global financial system with a daily trading volume of more than 3 trillion US dollars, which makes it the most attractive for traders and investors with different investment horizons. This necessitates the improvement of existing and development of new effective analytical tools for monitoring and forecasting exchange rates. Recently an important part of the foreign exchange market has becomes the market of innovative financial instruments – cryptocurrencies. Its capitalization reached 1 trillion US dollars by the beginning of 2021. It can be concluded that cryptocurrencies perform all the classic functions of money and are a full-fledged cash, so they can be considered as alternative financial instruments for investment and trading. Critical analysis of the classical methodology and forecasting tools of currency quotes based on using technical analysis, econometric modeling, and time series approaches shows that it has limited practical value.

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. Дербенцев Василь Джоржович
2. Derbentsev Vasyl Dgorgovych

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. Данильчук Ганна Борисівна

2. Danilchuk Hanna Borysivna

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

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Бабенко Віталіна Олексіївна

2. Babenko Vitalina Oleksiivna

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

Рецензенти

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Петренко Людмила Миколаївна

2. Petrenko Luydmila Micolaivna

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

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Кравченко Володимир Георгійович
2. Kravtchenko Vladimir Georgyevitch

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

VIII. Заключні відомості

Власне Прізвище Ім'я По-батькові голови ради — Матвійчук Андрій Вікторович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні — Матвійчук Андрій Вікторович

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності — Баланчук І.С.