Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0411U003051

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 18-04-2011

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Мезенцев Олексій Миколайович
2. Mezentsev Oleksiy Mikolayovich

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: 21-03-2011

Спеціальність за освітою: 8.050106

Місце роботи здобувача: Європейський університет фінансів, інформаційних систем, менеджменту і бізнесу

Код за ЄДРПОУ: 24984886

Місцезнаходження: 50086, м. Кривий Ріг, вул. Галенко, 2

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): Д26.006.07

Повне найменування юридичної особи:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

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: 03680, м.Київ, пр.Перемоги, 54/1

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.35.21

Тема дисертації:

1. Моделювання критичних та кризових явищ на валютному ринку

2. Modelling of the critical and crisis events in currency market

Реферат/анотація:

1. Дисертація містить результати моделювання кризових явищ на валютному ринку на підґрунті теорії складних систем. У роботі доведено, що класичні підходи фундаментального і технічного аналізу не дозволяють здійснити надійних прогнозів щодо втрати нестабільності валютного ринку і формування кризового явища. Яскравим свідченням цьому є неочікуваність світової кризи 2007-2009 рр. Показано, що сучасний валютний ринок є складною динамічною системою, яку можна охарактеризувати множиною фундаментальних властивостей: нелінійність, синергетичність, емерджентність, фрактальність. Кількісні показники цих властивостей використовуються для побудови індикаторів ваютних криз. Побудовано індикатори-передвісник валютних кризи на основі розрахунку локального коефіцієнту Херста, який помітно зменшується у передкризовий. Моделювання ентропійних показників показало, що вейвлет-ентропія являється індикатором-передвісником кризового явища, тоді як ентропії Шеннона, Тсалліса і ентропію подібності можна використати у якості індикаторів валютної кризи. Для нестаціонарних і досить коротких

часових рядів розроблено рекурентні індикатори валютних криз.

2. Dissertation contains the results of design of the crisis phenomena at the currency market on subsoil of complex systems theory. It is proved in work, that classic approaches of fundamental and technical analysis do not allow to carry out reliable prognoses in relation to the loss of instability of currency market and forming of the crisis phenomenon. By a fresh certificate there is surprise of 2007-2009 world crisis. It is shown that a modern currency market is the complex dynamic system which can be described the plural of fundamental properties: non-linearity, synergy, emergency, fractal. The quantitative indexes of these properties are utillized for the construction of currency crises indicators. It is built indicator-precursor currency crises on the basis of calculation local the Hurst's coefficient, which notedly diminishes in precrisis period. The design of entropy indexes showed that wavelet-entropy was indicator-precursor of the crisis phenomenon, while of Shennon enropy, Tsallis entropy and approximate entropy can be utillized in quality of indicators of currency crisis. For nonstationary and short enough time series the recurrent indicators of currency crises are developed.

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. Макаренко Олександр Іванович
2. Makarenko Oleksandr Ivanovich

Кваліфікація: к.ф.-м.н., 01.02.01

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. Даніч Віталій Миколайович
2. Даніч Віталій Миколайович

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. Дмитришин Леся Ігорівна
2. Дмитришин Леся Ігорівна

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 Вітлінський Вальдемар Володимирович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Вітлінський Вальдемар Володимирович

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Т.А.