Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0418U000244

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 29-03-2018

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Вовк Володимир Романович
2. Vovk Volodymyr Romanovych

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: 01-03-2018

Спеціальність за освітою: 8.050102

Місце роботи здобувача: Львівський національний університет імені Івана Франка

Код за ЄДРПОУ: 02070987

Місцезнаходження: 79000, м. Львів, вул. Університетська, 1

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 20.051.12

Повне найменування юридичної особи: Коломийський інститут ДВНЗ "Прикарпатський національний університет імені Василя Стефаника"

Код за ЄДРПОУ: 25735101

Місцезнаходження: вул. Лисенка, 8, м. Коломия, Коломийський р-н., Івано-Франківська обл., 78200, 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: Львівський національний університет імені Івана Франка

Код за ЄДРПОУ: 02070987

Місцезнаходження: 79000, м. Львів, вул. Університетська, 1

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.35.51, 06.35.51

Тема дисертації:

1. Моделювання діяльності учасників фондового ринку за умов невизначеності.

2. Modeling the activities of stock market participants in conditions of uncertainty.

Реферат/анотація:

1. Дисертаційна робота присвячена обґрунтуванню теоретичних положень, розробці практичних рекомендацій та комплексу економіко-математичних моделей щодо прийняття ефективних рішень учасниками фондового ринку, що вимагає максимально точного прогнозування дохідності цінних паперів, оцінки їх ризиків та врахування якісних чинників, які найбільше впливають на процеси на фондовому ринку.Досліджено, що фінансові часові ряди цін акцій українських компаній володіють умовною гетероскедастичністю. Це дало змогу ефективно прогнозувати волатильність дохідності акцій використовуючи GARCH?моделі.У роботі дослідження проводились на даних котирувань акцій з 1.04.2009 р. по 31.08.2017 р. п'яти українських компаній, які користувалися найбільшим попитом на біржовому ринку України у 2016 р. за обсягом виконаних біржових контрактів: ПАТ "Державна енергогенеруюча компанія "Центренерго", ПАТ "Райффайзен Банк Аваль", ПАТ "Мотор Січ", ПАТ "Укрнафта" та ПАТ

"Укртелеком".Побудовано та досліджено комплекс моделей для прогнозування волатильності дохідності акцій кожної з компаній, а саме: GARCH(1,1), GARCH(2,1), GJR-GARCH(1,1), GJR-GARCH(2,1), EGARCH(1,1), EGARCH(2,1). На підставі найкращої з них для кожної компанії розраховано прогнозні значення волатильності дохідності акцій на 10-ти денний період.

2. The dissertation is devoted to the substantiation of theoretical positions and the development of practical recommendations and a set of economic and mathematical models for making effective decisions by the participants of a stock market, which requires the most accurate forecasting of the yield of securities, the assessment of their risks and taking into account the qualitative factors that affect the processes on the stock market most of all.Financial time series of quotations of shares of Ukrainian companies were found to have conditional heteroskedasticity. This allows to effectively predict stock volatility using the GARCH-models.The research was conducted on the data of stock price quotes from 1/4/2009 to 31/08/2017 of five Ukrainian companies that enjoyed the greatest demand in the Ukrainian stock market in 2016 as to the volume of exchange contracts executed: PJSC "State Power Generating Company "Tsentrenergo", PJSC "Raiffeisen Bank Aval", PJSC "Motor Sich", PJSC "Ukrnafta" and PJSC "Ukrtelecom".A set of models for forecasting the volatility of the yield of each company's shares was constructed and investigated, namely GARCH(1,1), GARCH(2,1), GJR-GARCH(1,1), GJR-GARCH(2,1), EGARCH(1,1), EGARCH(2,1). Based on the best for each company, predicted values of yield volatility on stock were calculated for a 10-day period.

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. Приймак Василь Іванович

2. Pryimak Vasyl Ivanovych

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. Приймак Василь Іванович
2. Pryimak Vasyl Ivanovych

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

VII. Відомості про офіційних опонентів та рецензентів

Офіційні опоненти

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Максишко Наталія Костянтинівна
2. Максишко Наталія Костянтинівна

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. Максишко Наталія Костянтинівна

2. Максишко Наталія Костянтинівна

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. Буртняк Іван Володимирович
2. Буртняк Іван Володимирович

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. Буртняк Іван Володимирович
2. Буртняк Іван Володимирович

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 Благун Іван Семенович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Благун Іван Семенович

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Т.А.