Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0516U000438

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 31-05-2016

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Пластун Олексій Леонідович
2. Plastun Oleksii Leonidovych

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: доктор наук

Аспірантура/Докторантура: ні

Шифр наукової спеціальності: 08.00.08

Назва наукової спеціальності: Гроші, фінанси і кредит

Галузь / галузі знань: Не застосовується

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 12-05-2016

Спеціальність за освітою: 8.050104

Місце роботи здобувача: Сумський державний університет

Код за ЄДРПОУ: 05408289

Місцезнаходження: 40007, м. Суми, вул. Римського-Корсакова 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): Д 55.081.01

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: Українська академія банківської справи

Код за ЄДРПОУ: 23635020

Місцезнаходження: 40030,Україна,м.Суми,вул.Петропавлівська,57

Форма власності:

Сфера управління: Національний банк України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.73.07

Тема дисертації:

1. Прогнозування цін на фінасових ринках на основі біржової інформації

2. Price forecasting in financial markets based on the market data

Реферат/анотація:

1. Дисертація присвячена розробці теоретико-методологічних засад прогнозування цін на фінансових ринках на основі використання біржової інформації. У роботі досліджено сутність та особливості прогнозування цін на фінансових ринках; досліджено основні концепції, що пояснюють динаміку цін на фінансових ринках; охарактеризовано науково-методичні засади використання біржової інформації для прогнозування цін на фінансових ринках; проаналізовано теоретико-методологічні основи технічного та фундаментального аналізу біржової інформації; досліджено роль прогнозування цін на фінансових ринках у зниженні рівня інформаційної асиметрії в економіці; розроблено науково-методичний підхід до прогнозування цін на фінансових ринках на основі оцінки взаємного впливу фінансових активів; розвинуто методологію технічного аналізу шляхом розробки індикатора класу осциляторів; розроблено науково-методичний підхід до прогнозування цінових бульбашок на фінансових ринках; досліджено специфіку використання імітаційного моделювання при прогнозуванні цін на фінансових ринках; розроблено науково-методичний підхід до прогнозування кризових явищ на фінансових ринках на основі аналізу їх волатильності; розроблено

модель прогнозу цін на фінансових ринках під час виникнення форс-мажорних ситуацій; удосконалено науково-методичні підходи до прогнозування цін на фінансових ринках на основі гіпотези надреакцій; досліджено персистентність цін на фінансових ринках в умовах кризи; доведено присут-ність "ефекту вихідних днів" на фондовому ринку України.

2. TThis dissertation is devoted to development of theoretical and methodological foundations of the price forecasting in financial markets based on the market data. The essence and specific of the prices forecasting in the financial markets are investigated. Basic theories devoted to the explanation of prices behavior in the financial markets are discussed. The methodological basis of the use of market data to price forecasting in financial markets is characterized. Methodology of the technical and fundamental analysis is discussed. The role of forecasting in the financial market as an instrument of information asymmetry reduction is investigated. Methodology of price forecasting based on mutual influence of financial assets is developed. A brand new technical indicator of oscillatory class is proposed. Price bubbles forecasting methodology is proposed. Specificity of the imitation modeling use for price forecasting in financial markets is investigated. Methodology of crisis prediction based on volatility analysis is developed. Model of price forecasting during the force-major events is proposed. Methodological tools for price forecasting based on the overreaction hypothesis are improved. Weekend effect in the Ukrainian stock market is investigated.

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. Козьменко Сергій Миколайович

2. Kozmenko Serhiy Mykolayovych

Кваліфікація: д.е.н., 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

VII. Відомості про офіційних опонентів та рецензентів

Офіційні опоненти

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Вовчак Ольга Дмитрівна

2. Вовчак Ольга Дмитрівна

Кваліфікація: д.е.н., 08.02.03

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. Грабчук Оксана Миколаївна

2. Грабчук Оксана Миколаївна

Кваліфікація: д.е.н., 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. Колодізєв Олег Миколайович

2. Колодізєв Олег Миколайович

Кваліфікація: д.е.н., 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

Рецензенти

VIII. Заключні відомості

Власне Прізвище Ім'я По-батькові голови ради Костюк Олександр Миколайович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Костюк Олександр Миколайович

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності Юрченко Т.А.