Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0413U001368

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 21-02-2013

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Коновалюк Максим Михайлович
2. Konovaliuk Maksym Mikhailovich

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: 18-02-2013

Спеціальність за освітою: 8.080203

Місце роботи здобувача: Національний технічний університет України "Київський політехнічний інститут імені Ігоря Сікорського"

Код за ЄДРПОУ: 02070921

Місцезнаходження: 03056, м.Київ, пр.Перемоги, 37

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 02.002.03

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: Національний технічний університет України "Київський політехнічний інститут імені Ігоря Сікорського"

Код за ЄДРПОУ: 02070921

Місцезнаходження: 03056, м.Київ, пр.Перемоги, 37

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 28.17.05

Тема дисертації:

1. Інформаційна технологія для оцінювання і прогнозування нелінійних нестаціонарних фінансових процесів

2. Information technology for estimation and forecasting of nonlinear nonstationary financial processes

Реферат/анотація:

1. Дисертаційна робота присвячена розробці нових моделей, алгоритмів і технологій аналізу фінансових даних. У роботі запропоновано оцінювати параметри моделі стохастичної волатильності за алгоритмом Гіббса, який використовує моду оберненого гамма розподілу та модифіковану умову прийняття або відхилення пропонованої оцінки параметра. Запропоновано модифіковану модель стохастичної волатильності. Запропоновано підхід для розрахунку прогнозованих значень кількісної величини ризику. На основі моделей змінної волатильності та методів оцінювання параметрів нелінійних моделей створено інформаційну систему для прогнозування волатильності валютного курсу.

2. The thesis deals with the problem of development and implementation of a new information technology for solving the problems of modeling and forecasting nonlinear nonstationary processes. The main goal of the research is to enhance the quality of financial processes forecasts. At the next step the forecasts are used for estimation of possible financial losses with VaR methodology. An analysis of existing methods for forecasting

financial processes with the use of autoregressive conditionally heteroscedastic models has been performed. It was used for short term forecasting of volatility with further use of the forecasts for risk estimation. A new structure for the stochastic volatility model was proposed.

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. Бідюк Петро Іванович
2. Bidiuk Petro Ivanovich

Кваліфікація: д.т.н., 05.13.03

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. Коваленко Ігор Іванович
2. Коваленко Ігор Іванович

Кваліфікація: д.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

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Кулян Віктор Романович
2. Кулян Віктор Романович

Кваліфікація: к.т.н., 05.13.16

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 Павлов Олександр Анатолійович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Павлов Олександр Анатолійович

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Т.А.