Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0419U005272

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 16-12-2019

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Даценко Наталія Володимирівна
2. Datsenko Nataliia V.

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: ні

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: 02-12-2019

Спеціальність за освітою: Економічна кібернетика

Місце роботи здобувача: ДВНЗ "Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана"

Код за ЄДРПОУ: 02070884

Місцезнаходження: проспект Перемоги, 54/1, м. Київ, 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: ДВНЗ "Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана"

Код за ЄДРПОУ: 02070884

Місцезнаходження: проспект Перемоги, 54/1, м. Київ, 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: ДВНЗ "Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана"

Код за ЄДРПОУ: 02070884

Місцезнаходження: проспект Перемоги, 54/1, м. Київ, 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: 06.35.51

Тема дисертації:

1. Система моделей оцінювання та прогнозування інноваційних фінансових інструментів (на прикладі криптовалют)

2. Model system for evaluating and forecasting innovative financial assets (cryptocurrencies)

Реферат/анотація:

1. Дисертація присвячена подальшому розвитку теоретичних засад та розробці інструментарію моделювання та прогнозування динаміки інноваційних фінансових інструментів на прикладі криптовалют. Визначено роль та місце криптовалют на сучасному етапі розвитку світової економіки, уточнено категоріальний апарат та економічну сутність дефініції «криптовалюта», розроблено таксономію криптовалют на підставі їх технологічних та криптографічних властивостей. Запропоновано концептуальний підхід до оцінювання та короткострокового прогнозування криптоактивів на основі міжгалузевого стандарту організації інтелектуального аналізу даних CRISP-DM. Розроблено алгоритм бінарного авторегресійного дерева, який дозволяє здійснювати кусково-лінійну апроксимацію фазового простору вхідних лагових змінних та будувати власну авторегресійну модель для кожного сегменту. Здійснено чисельну оцінку горизонту

прогнозу із використанням фрактального та ентропійного аналізу та проведено модельні прогнозні розрахунки динаміки часових рядів криптовалют як із використанням моделей BART, так і моделей сімейства ARIMA-ARFIMA. Проведене теоретичне та експериментальне дослідження засвідчило адекватність побудованих моделей та ефективність їх застосування з метою підтримки і прийняття управлінських рішень на крипторинку.

2. The dissertation is devoted to the further development of theoretical basis and experimental tools for modeling and forecasting dynamics of innovative financial assets (cryptocurrencies). The thesis is defined the role and place of cryptocurrencies in the current level of the world economy progress, clarifies the categorical apparatus and economic essence of the definition of «cryptocurrency», developed taxonomy of cryptocurrencies on the basis of their technological and cryptographic properties. A conceptual approach to the evaluation and short-term forecasting of crypto-assets based on the CRISP-DM data mining inter-industry standard is proposed. The binary autoregression tree algorithm (BART) is proposed. This model performs piecewise linear approximation phase space and build an autoregressive model for each segment. Numerical estimation of the forecast horizon was calculated using fractal and entropy analysis, and cryptocurrencies time series forecasts were performed using BART and ARIMA-ARFIMA models. The conducted theoretical and experimental study showed the adequacy of the built models and the effectiveness of their application in order to support making decisionson on the crypto market.

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. Коляда Юрій Васильович
2. Koliada Yurii V.

Кваліфікація: к.т.н., 05.13.12

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. Maksishko Nataliia K.

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. Данильчук Ганна Борисівна
2. Danilchuk Hanna B.

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.