Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0410U000748

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 22-03-2010

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Куссий Михайло Юрійович
2. Kussy Mykhailo Yuriyovych

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: 26-02-2010

Спеціальність за освітою: 7.080101, 7.050104

Місце роботи здобувача: Таврійський національний університет імені В.І. Вернадського

Код за ЄДРПОУ: 02070967

Місцезнаходження: 01042м.,Київ, вул.Івана Кудрі, 33

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д 64.055.01

Повне найменування юридичної особи: Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця

Код за ЄДРПОУ: 02071211

Місцезнаходження: проспект Науки, 9-А, м. Харків, Харківський р-н., Харківська обл., 61166, 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: Таврійський національний університет імені В.І. Вернадського

Код за ЄДРПОУ: 02070967

Місцезнаходження: 01042м.,Київ, вул.Івана Кудрі, 33

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.35.51

Тема дисертації:

1. Моделювання динаміки ціни на FOREX з використанням фрактальності та волатильності ринку
2. Modelling of price's dynamics on FOREX with using of market's fractality and volatility

Реферат/анотація:

1. Об'єкт дослідження: динаміка ціни на FOREX та фактори, що впливають на її зміну; мета роботи: розробка комплексу економіко-математичних моделей для аналізу й прогнозування курсів валют, що враховують фрактальність структури ринку і його волатильність; методика дослідження та апарат: системний аналіз, методи фрактального аналізу, ентропійний метод Грассбергера-Прокаччіа, методи проектування торговельних систем, поставлені завдання вирішувались за допомогою пакетів прикладних програм Microsoft Excel та C++; теоретичні та практичні результати: уточнено категорії фрактальної структури ринку і його волатильності, побудовано концептуальну модель дослідження динаміки ціни на ринку капіталів, яка базується на двох таких основних поняттях ринку як фрактальність і волатильність, застосування теоретико-методичних розробок дозволяє підвищити обґрунтованість інвестиційних рішень та рентабельність торговельних операцій, комплекси економіко-математичних моделей: комплекс з урахуванням фрактальної

структури ринку капіталів, і комплекс моделей з використанням показника поточної волатильності, що дозволяють визначати причини, що викликають зміни в динаміці ціни, своєчасно прогнозувати ці зміни з метою підвищення рентабельності інвестицій торговців цінними паперами та компаній з управління активами, а також підвищення ступені обґрунтованості рішень щодо конвертаційних операцій з валютою працівникам валютних відділів банків, запропоновано показник поточної волатильності для кількісної оцінки рефлексивності ринку, що дозволяє прогнозувати найближчі зміни активності торгів, підвищує оперативність реакції економічного агента на поточні зміни в динаміці ціни й дозволяє виключити вплив попередньої динаміки на процес прийняття рішень, розроблений метод сполучених екранів, у якому, на відміну від існуючих підходів, уведений постулат про необхідність фіксації інвестиційно-часового горизонту при здійсненні торговельних операцій у режимі реального часу, цей метод можна ефективно використовувати для аналізу діючих трендів на FOREX з урахуванням фрактальності ринку капіталів, практичну цінність мають розроблені здобувачем критерії ефективності роботи розроблених моделей, за допомогою яких економічні агенти вибирають найбільш привабливі значення керуючих параметрів моделей, досліджено також область ефективного використання запропонованих моделей; предмет і ступінь впровадження: пропозиції й рекомендації впроваджені та використовуються у практичній роботі торговців цінними паперам, а саме: ТОВ «Східно-Кримська фондова компанія», ЗАТ «Інвестиційна Група МАСТ», у роботі валютного відділу Кримського Регіонального Департаменту АКБ «ТАС-Комерцбанк», та відділу валютних операцій та контролю ВАТ «ВТБ Банк»; сфера використання: аналіз та прогнозування динаміки ціни на ринках капіталів.

2. The object of the research: price's dynamics on FOREX and factors, which are influencing upon its change; The purpose of work: elaboration of economic and mathematical models complex for analysis and forecasting rate of exchanges, which takes into account of market's fractality structures and its volatility; Research methodology and instruments: system analysis, fractal's methods analysis, Grassberger-Prokachchia entropy's method, methods of trade system's projecting, tasks, that was putted are deciding by means of package of the applied programs Microsoft Excel and C++; Theoretical and practical results: categories of market's fractality structures and its volatility is elaborated, conceptual model of capital market's price elaboratoring, which is based on two such main market's conceptions as fractality and volatility, is built, using theorist-methodical developments allows to raise the validity of investment decisions and trade operation's profitability, complexes of the economic and mathematical models: complex of the models with using of capital market's fractal structure, and complex of the models with using current volatility's factor, which allow to define the reasons, which cause the changes of the price's dynamics, forecast these change for the reason increasing of investment's profitability merchant by securities and companies on control asset and increasing substitution's degree of decisions comparatively of converter operation with currency of banks exchange division's workman in good time, current volatility's factor for quantitative estimation of market's reflexivity, which allows to forecast nearest changes of the sale's activities and raises economic agent's executive reactions on the current changes of price's dynamics and allows to exclude the influence of previous dynamics on process decision making is offered, combined screen's method, in which, unlike existing approach, postulate about needing of investment-temporary horizon's fixing is entered for realization of trade operation in mode of the real-time is developed, there is possible effectively to use this method for analysis acting trends on FOREX with provision for capital market's fractality, practical value has designed by competitor of efficiency's criteria of the designed models functioning, by means of which economic agents choose the most attractive importance controlling parameter of the models, also area of the efficient using of offered models explored; Subject and degree of introduction: offers and recommendations are introduced and used in practical functioning merchant by securities, as follows: LTD «East-Crimean stock company», CJSC «Investment Group MAST», in functioning the exchange division of the Crimean branch of JSCB «TAS-Komerzbank», and division exchange of operation and checking OJSC «VTB Bank»; The sphere of application: analysis and forecasting of capital market price's dynamics.

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. Єрмоленко Геннадій Григорович
2. Ermolenko Gennady Grygorovych

Кваліфікація: к.т.н., 05.07.01

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. Черняк Олександр Іванович
2. Черняк Олександр Іванович

Кваліфікація: д.е.н., 08.03.02

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. Стрижиченко Костянтин Анатолійович

2. Стрижиченко Костянтин Анатолійович

Кваліфікація: к.е.н., 08.03.02

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 Пономаренко Володимир Степанович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Пономаренко Володимир Степанович

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

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