Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0416U004499

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 07-11-2016

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Горун Павло Павлович

2. Gorun Pavlo Pavlovych

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: ні

Шифр наукової спеціальності: 01.05.02

Назва наукової спеціальності: Математичне моделювання та обчислювальні методи

Галузь / галузі знань: Не застосовується

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 21-10-2016

Спеціальність за освітою: 8.080202

Місце роботи здобувача: ТзОВ "Інтерлогіка"

Код за ЄДРПОУ: 32894424

Місцезнаходження: 79000, м. Львів, вул. Грабовського, 11

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): К 76.051.02

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 університет "Львівська політехніка"

Код за ЄДРПОУ: 02071010

Місцезнаходження: 79013, Україна, м.Львів, вул. С.Бандери, 12

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 27.43.15

Тема дисертації:

1. Дискретна процедура стохастичної оптимізації з марковськими переключеннями

2. Discrete procedure of stochastic optimization with Markov switchings

Реферат/анотація:

1. Дисертаційна робота присвячена дослідженню поведінки та достатніх умов збіжності дискретної процедури стохастичної оптимізації (ПСО) в марковському випадковому середовищі під впливом дифузійних збурень в умовах балансу (з рівновагою). У роботі встановлено достатні умови збіжності дискретної ПСО до точки екстремуму усередненої системи в схемах усереднення та дифузійної апроксимації, коли вихідне стохастичне диференціальне рівняння, крім функції регресії, визначається дифузійним збуренням, яке, у свою чергу, може залежати від випадкової еволюції. Досліджену ПСО використано для знаходження оптимального інвестиційного портфеля для моделі Марковіца.

2. The thesis is devoted to the research of behavior and sufficient conditions of discrete stochastic optimization procedure (SOP) in Markov environment under diffusive perturbations in case of balance condition (with equilibrium). It has been established sufficient conditions for the convergence of a discrete SOP to extreme point of averaged system in average and diffusion approximation schemes in the case of diffusive perturbation on the stochastic differencial equation, that also depends on random evolution. Finally, researched procedure was applied

to finding optimal investment portfolio for Markovitz model.

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. Чабанюк Ярослав Михайлович
2. Chabanyuk Yaroslav Mykhaylovych

Кваліфікація: д.ф.-м.н., 01.05.04

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. Ясинський Володимир Кирилович
2. Ясинський Володимир Кирилович

Кваліфікація: д.ф.-м.н., 01.05.02

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. Вовк Лілія Борисівна

2. Вовк Лілія Борисівна

Кваліфікація: к.ф.-м.н., 01.05.02

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	Петришин Роман Іванович
Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні	Петришин Роман Іванович
Відповідальний за підготовку облікових документів	
Реєстратор	

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Т.А.