# Облікова картка дисертації

## I. Загальні відомості

**Державний обліковий номер:** 0411U003157

**Особливі позначки:** відкрита

**Дата реєстрації:** 22-04-2011

**Статус:** Захищена

**Реквізити наказу МОН / наказу закладу:**

## II. Відомості про здобувача

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові:**

1. Есфандіярфард Маліхех
2. Esfandiaryfard Maliheh

**Кваліфікація:**

**Ідентифікатор ORCID ID:** Не застосовується

**Вид дисертації:** кандидат наук

**Аспірантура/Докторантура:** так

**Шифр наукової спеціальності:** 01.05.04

**Назва наукової спеціальності:** Системний аналіз і теорія оптимальних рішень

**Галузь / галузі знань:** Не застосовується

**Освітньо-наукова програма зі спеціальності:** Не застосовується

**Дата захисту:** 18-04-2011

**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 26.002.03

**Повне найменування юридичної особи:** Навчально-науковий комплекс "Інститут прикладного системного аналізу" Національного технічного університету України "Київський політехнічний інститут імені Ігоря Сікорського"

**Код за ЄДРПОУ:** 25408067

**Місцезнаходження:** проспект Перемоги, 37 , корпус 35, м. Київ, Київська обл., 03056, 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:** 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:** 50.07.07

**Тема дисертації:**

1. Оптимізація инвестиційного портфеля в нечітких умовах з використанням прогнозування
2. Fuzzy Portfolio Optimization Under Uncertainty Using Forecasting

**Реферат:**

1. Дисертаційна робота присвячена вирішенню проблеми аналізу та оптимізації інвестиційних портфелів з акцій в умовах невизначеності з використанням прогнозування. В роботі побудовано модель оптимізації нечіткого інвестиційного портфеля в умовах невизначеності на основі використання апарату нечітких множин та проведено узагальнення цієї моделі для гаусівської та колоколоподібної функцій належності. Запропоновано алгоритм нелінійного програмування для вирішення проблеми оптимізації нечіткого портфеля. Проведено дослідження залежності "оптимальна дохідність - ризик" для нечіткого портфеля та знайдено достатні умови, за яких ця залежність на відміну від класичної задачі портфельної оптимізації матиме монотонно спадний характер. Показано, що основним недоліком нечітко-множиного підходу до оптимізації інвестиційного портфеля є те . що він базується на застарілих даних. Тому з метою підвищення

обґрунтованості рішень запропоновано використання прогнозування. В роботі розвинено нечіткий метод МГУА для прогнозування курсів акцій, Проведені експериментальні дослідження показали, що використання прогнозування цін акцій в задачі оптимізації інвестиційного портфеля в умовах невизначеності дозволяє отримати більш ефективні рішення щодо складу портфеля та знизити ризик від помилкових рішень.

2. The dissertation is dedicated to the problems of portfolio optimization under uncertainty.In the dissertation new approach for the solution of the portfolio problem is suggested in which the stock prices are considered as fuzzy numbers given in some intervals. In this case the portfolio profitableness will be also a fuzzy number distributed in the corresponding interval and the risk is considered as possibility of events when real profitableness would be less than some criterion value. The corresponding model of fuzzy portfolio optimization problem was constructed and special algorithm of its solution suggested. This model was extended for different membership functions of portfolio profitableness, namely Gaussian and bell-wise form. The dependence "optimal profitableness- risk" for fuzzy portfolio was investigated and the sufficient conditions of its monotonous decreasing form were found. The experimental investigations of fuzzy portfolio problem at the Russian stock exchange were carried out.

**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. Зайченко Юрій Петрович
2. Zajchenko Yurij Petrovych

**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

## VII. Відомості про офіційних опонентів та рецензентів

**Офіційні опоненти**

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові:**

1. Волошін Олексій Федорович
2. Волошін Олексій Федорович

**Кваліфікація:** д.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

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові:**

1. Лопатін Олексій Костянтинович
2. Лопатін Олексій Костянтинович

**Кваліфікація:** д.ф.-м.н., 01.01.02

**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** 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.