

Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0410U006638

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 24-12-2010

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:



II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Кроптя Арсеній Володимирович

2. Kroptya Arsenij Volodymyrovych

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: ні

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: 21-12-2010

Спеціальність за освітою: 8.080404

Місце роботи здобувача: Державне підприємство Головний інформаційно-обчислювальний центр
Укрзалізниці

Код за ЄДРПОУ: 21579381

Місцезнаходження: м.Київ-01030, вул. Ів.Франка, 21

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство транспорту та зв'язку України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д26.002.03

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:

Код за ЄДРПОУ: 02070921

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 28.29.04

Тема дисертації:

1. Моделі багатовимірних ризиків в корпоративних системах підтримки прийняття рішень
2. Multivariate risk models in enterprise decision support systems

Реферат:

1. У дисертаційній роботі запропонована системна методологія побудови та використання статистично-ймовірнісних багатовимірних моделей ризиків, що виникають у складних фінансово-економічних системах, в інформаційних системах підтримки прийняття рішень з управління ризиками. Розроблено метод побудови комбінованого розподілу ризику шляхом поєднання екстремального і нормального розподілів у єдиній моделі. Запропоновано кількісне оцінювання ризику ризиковим профілем у вигляді мір ризику та мір відхилення ризику. Запропоновано багатовимірну модель ризиків на основі копул та маргінальних комбінованих розподілів. Розроблено методи визначення кількості факторів ризику шляхом аналізу власних чисел матриць мір залежності методами теорії випадкових матриць.

2. The dissertation is dedicated to development of a complex system model and application methodology with probability multivariate risk models, for complex financial and economic systems, in informational risk management decision support systems. Based on analysis of risk estimation and management problem, argued urgency of modeling risk with nonlinear asymmetric interaction problem. Developed a new method for risk

characteristics distribution construction by combining generalized Pareto distribution and normal distribution in joint model for extremely large and common risk values. Proposed quantitative risk evaluation through risk profile build from quantitative risk measures and deviation measures, for evaluation loss values risk and loss uncertainty risk at the same time. Proposed multivariate risk modeling of dependent risks based on marginal combined distributions and copulas. Active risk management portfolio optimal structure problem was solved by flexible multivariate joint distribution modeling. In thesis proved usefulness of developed methods for number of risk factors determination in economic system by analysis eigenvalues of correlation and concordance matrices. Proposed models and methods are implemented in decision support system for Ukrainian Railways.

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. Bidyuk Petro Ivanovych

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. Крак Юрій Васильович
2. Крак Юрій Васильович

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**Власне Прізвище Ім'я По-батькові:**

1. Житецький Леонід Сергійович
2. Житецький Леонід Сергійович

Кваліфікація: к.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**Рецензенти****VIII. Заключні відомості****Власне Прізвище Ім'я По-батькові
голови ради**

Павлов Олександр Антатолійович

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові
головуючого на засіданні**

Павлов Олександр Антатолійович

**Відповідальний за підготовку
облікових документів**

Реєстратор

**Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є
відповідальним за реєстрацію наукової
діяльності**



Юрченко Т.А.