Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0400U000939

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 18-04-2000

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Маліч Людмила Анатолієвна

2. Malich Lyudmyla Anatoliyevna

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: ні

Шифр наукової спеціальності: 08.03.02

Назва наукової спеціальності: Економіко-математичне моделювання

Галузь / галузі знань: Не застосовується

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 29-03-2000

Спеціальність за освітою: 0611

Місце роботи здобувача: Донецький національний університет імені Василя Стуса

Код за ЄДРПОУ: 02070803

Місцезнаходження: 21021, м.Вінниця, вул. 600-річчя, 21

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): К 11.051.01

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: Донецький національний університет імені Василя Стуса

Код за ЄДРПОУ: 02070803

Місцезнаходження: 21021, м.Вінниця, вул. 600-річчя, 21

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. Економіко-математичне моделювання та прогноз характеристик цінних паперів

2. Economical-mathematical modeling and forecasting the securities characteristics

Реферат/анотація:

1. Об'їкт дослідження: емітенти та інвестори фондового ринку в операціях емісіє й обігу. Мета дослідження: розробка економіко-математич-ного інструментарію оцінки та прогнозу характеристик цінних паперів на первинному і вторинному ринках в умовах переходу економіки до ринкових відносин. Методи дослідження: економіко-математичне моделювання, методи аналізу і синтезу, теоріє ймовірностей і математичноє статистики, методи оптимізаціє, імітаційного моделювання та теоріє рядів. Результати: проведено системний аналіз вітчизняного фондового ринку, характеристик цінних паперів, показників єх емісіє і обігу; виділено загальнометодологічні аспекти прогнозування і особливості єх застосування для вітчизняного фондового ринку; сформовано концепцію економіко-математичного моделювання характеристик цінних паперів та єх компонування у портфель; синтезовано економіко-математичні моделі прогнозу вартості і доходності облігацій в умовах жорсткого оподаткування; оцінено ризик операцій з облігаціями, вирішено задачу оператив ного формування і управління імунізованими портфелями ризикових і безризикових активів; розроблено алгоритм прогнозу характеристик цінних паперів і управління єх портфелями;

результати дослідження апробовано у ДФ АКБ "Новий" з економічним ефектом 240 тис. грн. Новітність: синтезовано економіко-математичні моделі прогнозу вартості купонних та безкупонних облігацій; розроблено економіко-математичні моделі прогнозу вартості і доходності облігацій в умовах неплатежів без прив'язки до рейтингів облігацій провідних емітентів; розроблено економіко-математичні моделі прогнозу характеристик емісій через введену функцію корисності; модифіковано сучасні критеріє оцінювання портфеля облігацій і розроблено відповідні моделі оцінки доходності портфелів різного компонування; синтезовано економіко-математичні моделі еволюціє цін і компонування портфеля акцій, що даї можливість динамічного варіювання активами портфелів. Область використання: республіканська

2. Object of research: issuers and investors of stock market in issue and circulation operations. Purpose of research: development of economic and mathematical tools of estimation and forecasting of securities' characteristics on primary and secondary markets in conditions of transition economy. Methods of research: economic and mathematical modeling, analysis and synthesis methods, probability theory, mathematical statistics, optimization methods, simulation and series theory. Results: system analysis of native stock market, securities characteristics, issue and circulation indexes is carried out; conception of economic and mathematical modeling of securities characteristics and their assembling into a portfolio is formed; economic and mathematical models of forecasting of costs and profitability of bonds in conditions of strict taxation is synthesed; risk of bond operation is estimated, problem of operative formation and management of immunized risky and non-risky assets portfolio is solved; algorithmo f securities characteristics forecasting and portfolio management is developed; results of research are approved in DF JSCB "Novy" with economic effect of 240 of thousands of hryvnia. Novelty: economic and mathematical models of bounds value forecasting are synthesed; economic and mathematical models of bond's value and profitability in conditions of non-payments and bonds rating by lead issuers are developed; economic and mathematical models of issue characteristics forecasting by means of utility function are developed; modern criteria of portfolio estimation are modified; economic and mathematical models of price evolution and portfolio assembly allowing the ability of dynamic variation of asset variation. Field of use: country level.

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. Гузь М.Г.

2. Гузь М.Г.

Кваліфікація: д.е.н., 08.06.02

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. Вітлінський В.В.

2. Вітлінський В.В.

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. Жорняк Т.С.

2. Жорняк Т.С.

Кваліфікація: к.е.н., 08.00.13

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 Лисенко Ю. Г.

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Лисенко Ю. Г.

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

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

