Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0517U000703

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 27-10-2017

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Заболоцький Тарас Миколайович
2. Zabolotskyy Taras Mykolaiovych

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: доктор 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: 04-10-2017

Спеціальність за освітою: 8.050110

Місце роботи здобувача: Львівський національний університет імені Івана Франка

Код за ЄДРПОУ: 02070987

Місцезнаходження: 79000, м. Львів, вул. Університетська, 1

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): Д26.006.07

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: ДВНЗ "Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана"

Код за ЄДРПОУ: 02070884

Місцезнаходження: пр.Перемоги, 54/1, м. Київ, 03057

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 06.35.51

Тема дисертації:

1. Моделювання за альтернативними гіпотезами в управлінні портфелем фінансових активів

2. Modeling under alternative hypotheses in the management of a portfolio of financial assets

Реферат/анотація:

1. Дисертація присвячена розробленню методології коректного застосування економіко-математичного інструментарію для підвищення ефективності оцінювання, аналізу та обґрунтування необхідності реструктуризації портфеля на підґрунті поглибленого постоптимізаційного аналізу та аналізу динаміки змін оцінок його ключових характеристик за альтернативних гіпотез. Обґрунтовано коректність використання вибіркових оцінок основних характеристик портфеля з найменшим рівнем VaR (CVaR). Розроблено методологію коректного застосування економіко-математичного інструментарію в управлінні (оцінювання, аналіз, обґрунтування необхідності реструктуризації) портфелем фінансових активів з найменшим рівнем VaR (CVaR) на основі економіко-математичного аналізу оцінок його характеристик за альтернативних, відносно класичної теорії портфеля, гіпотез. Розроблено концептуальні та відповідні методичні положення економіко-математичного моделювання взаємозв'язку між рівнем довіри до VaR та сподіваною дохідністю портфеля фінансових активів з найменшим рівнем VaR. Запропоновано концептуальні положення щодо

оцінювання значення коефіцієнта, що описує ставлення інвестора до ризику.

2. The dissertation is dedicated to the development of methodology of correct application of economic-mathematical tools with an aim of increasing efficiency of estimating, analysis and grounding of necessity of restructuring of portfolio on the basis of deep post optimization analysis and analysis of dynamics of changes of its main characteristics under alternative hypotheses. We justified the correctness of using of sample estimators of main characteristics of the minimum VaR (CVaR) portfolio. We develop the methodology of correct use of economic-mathematical tools in minimum VaR (CVaR) portfolio management (estimating, analysis, and grounding of necessity of restructuring) on the basis of economic-mathematical analysis of estimators of its main characteristics under alternative, relatively to classic portfolio theory, hypothesis. We present the stochastic representation of sample estimators of portfolio expected return, variance and the VaR (CVaR) which simplifies the application of imitation modeling for portfolio analysis. We proved that it is impossible to provide correct estimator of expectation of minimum VaR (CVaR) portfolio variance and variance of minimum VaR (CVaR) portfolio expected return. We develop conceptual principles of risk estimation of portfolio with the highest Sharpe ratio which is based on confidence level for VaR of the equivalent minimum VaR portfolio.

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. Вітлінський Вальдемар Володимирович
2. Vitlinskiy Valdemar Volodimirovich

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.11

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. Грицюк Петро Михайлович
2. Грицюк Петро Михайлович

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.11

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. Камінський Андрій Борисович
2. Камінський Андрій Борисович

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.11

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. Кузьменко Ольга Віталіївна
2. Кузьменко Ольга Віталіївна

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.11

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 Матвійчук Андрій Вікторович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Матвійчук Андрій Вікторович

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

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