Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0408U001480

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 10-04-2008

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Сидоренко Олександр Миколайович
2. Sydorenko Oleksandr Mykolayovych

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: так

Шифр наукової спеціальності: 05.13.06

Назва наукової спеціальності: Інформаційні технології

Галузь / галузі знань: Не застосовується

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 28-03-2008

Спеціальність за освітою: 7.050107

Місце роботи здобувача: Закрите акціонерне товариство «Інвестиційна група МАСТ»

Код за ЄДРПОУ: 14315500

Місцезнаходження: 61024, Україна, м. Харків, вул. Гуданова, 9/11

Форма власності:

Сфера управління: Держадміністрація

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д 64.062.01

Повне найменування юридичної особи: Національний аерокосмічний університет ім. М.Є. Жуковського "Харківський авіаційний інститут"

Код за ЄДРПОУ: 02066769

Місцезнаходження: вул. Чкалова, 17, м. Харків, Харківський р-н., Харківська обл., 61070, 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 аерокосмічний університет ім. М.Є. Жуковського "Харківський авіаційний інститут"

Код за ЄДРПОУ: 02066769

Місцезнаходження: Україна, 61070, м. Харків, вул. Чкалова, 17

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 20.53.01

Тема дисертації:

1. Моделі і методи автоматизованого управління портфелем цінних паперів на фондовому ринку

2. Models and methods of automated portfolio management on the stock market

Реферат/анотація:

1. Об'єктом дослідження є процес управління портфелем цінних паперів. Метою дослідження є підвищення ефективності інвестиційних рішень що приймаються при роботі на фондовому ринку за рахунок створення та розвитку методів і моделей, а також розробки інформаційних технологій управління портфелем цінних паперів. Основними методами дослідження є методи теорії нечітких множин для проведення аналізу фінансово-економічного стану підприємства, логіко-лінгвістичні методи для розрахунку вартості активів емітентів цінних паперів, методи технічного та фундаментального аналізу для оцінки вартості акцій. Наукове значення результатів визначається тим, що вони розвивають логіко-лінгвістичні методи, нечітко-множинні методи підтримки прийняття рішень, методи фундаментального аналізу акцій. Практичне значення полягає в тому, що вдосконалено модель розрахунку оціночної вартості акцій, розроблені моделі, методи та алгоритми управління портфелем цінних паперів є науково-практичною основою для створення системи

підтримки прийняття рішень для фондового ринку та автоматизованого робочого місця трейдера. Вперше одержано логіко-лінгвістичний метод розрахунку ставки дисконтування у залежності від результатів оцінки фінансово-економічного стану підприємства, який дозволяє у експертній системі оцінки акції рішати задачу класифікації та багатокритеріального вибору альтернатив в умовах невизначеності, та позбавлений таких недоліків, як суб'єктивність та складність визначення необхідних коефіцієнтів. Удосконалено метод оцінки фінансово-економічного стану підприємства за рахунок використання нечіткої логіки для розрахунку багаторівневого інтегрального коефіцієнту, який допомагає розв'язати задачу ранжування та порівняння підприємств згідно фінансових показників. Дістала подальший розвиток модель розрахунку вартості акції, яка використовується у механізмі логічного висновку експерної системи, та дозволяє визначити оціночну вартість акції та рівень інвестиційної привабливості підприємства. Впровадження – галузеве. Подальше використання отриманих в дисертації результатів доцільно у науково-дослідних, фінансових установах, наприклад, пенсійними фондами, у держустановах, таких як Фонд державного майна України, на підприємствах для оцінки ринкової капіталізації.

2. The object of a research is the process of management of the portfolio of securities. The purpose of a study is an increasing of efficiency of investment decisions during work at the fund market due to creation and development of models and methods, and also development of information technologies of management the portfolio of securities. Basic methods of research are methods of theory of fuzzy sets for conducting of analysis of the financial state of enterprise, logic-and-linguistic methods for the calculation of cost of assets of issuers, methods of technical and fundamental analysis for the shares. Scientific value is determined of, that they develop logic-and-linguistic methods, fuzzy-sets methods of support for making a decision, methods of fundamental analysis of securities. Practical values consists that the model of calculation of evaluation cost of shares is improved, the developed models, methods and algorithms of management the portfolio of securities, are scientific-and-practical basis for creation of the system of support of making a decision for a fund market and workstation of trader. The logic-and--linguistic method of calculation of rate of discounting depending on the results of estimation of the financial state of enterprise is first developed, which allows to decide the task of classification and multicriterion choice of alternatives in the conditions of vagueness, and deprived such failings, as subjectivity and complication of determination of necessary coefficients. The method of estimation of the financial state of enterprise is improved on the basis of calculation of multilevel integral coefficient which helps to decide the task of ranging and comparison of enterprises in obedience to their financial indexes. The model of calculation of cost of shares, which allows to define the evaluation cost of action, and also level of investment attractiveness of enterprise, got further development. Introduction is branch – based. The further use of the results got in dissertation is expedient in research, financial organizations, for example, pension a fund, in state institutions, such as State property fund of Ukraine, on enterprises for the estimation of market capitalization.

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. Ілюшко Віктор Михайлович
2. Ilyushko Viktor Mikhaylovich

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. Соколов Олександр Юрійович
2. Соколов Олександр Юрійович

Кваліфікація: д.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

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Косенко Віктор Васильович
2. Косенко Віктор Васильович

Кваліфікація: к.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

Рецензенти

VIII. Заключні відомості

Власне Прізвище Ім'я По-батькові голови ради	Чумаченко Ігор Володимирович
Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні	Чумаченко Ігор Володимирович
Відповідальний за підготовку облікових документів	
Реєстратор	
Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності	Юрченко Т.А.