Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0821U100045

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 10-01-2021

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Гуськова Віра Геннадіївна
2. Huskova Vira Hennadiivna

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: доктор філософії

Аспірантура/Докторантура: так

Шифр наукової спеціальності: 122

Назва наукової спеціальності: Комп'ютерні науки

Галузь / галузі знань:

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 05-01-2021

Спеціальність за освітою: Системи штучного інтелекту

Місце роботи здобувача: Національний технічний університет України "Київський політехнічний інститут імені Ігоря Сікорського"

Код за ЄДРПОУ: 02070921

Місцезнаходження: проспект Перемоги, буд. 37, м. Київ, Київська обл., 03056, Україна

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): ДФ 26.002.016

Повне найменування юридичної особи: Національний технічний університет України "Київський політехнічний інститут імені Ігоря Сікорського"

Код за ЄДРПОУ: 02070921

Місцезнаходження: проспект Перемоги, буд. 37, 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: проспект Перемоги, буд. 37, м. Київ, Київська обл., 03056, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 28.23.35

Тема дисертації:

1. Методи і моделі інтелектуального аналізу даних для оцінювання фінансових ризиків

2. Data mining methods and models for evaluating financial risks

Реферат/анотація:

1. У дисертаційній роботі проаналізовано основні фінансові ризики, управління якими є ключовим фактором, що визначає ефективність фінансової діяльності. Виконано аналіз діяльності банків та інших фінансових організацій, робота яких здійснюється під впливом невизначеностей зовнішнього середовища (ринку, економіки, політики тощо), великої кількості змінних, контрагентів, осіб, поведінка яких не завжди може бути передбачена з прийнятною точністю. Розглянуто можливість мінімізації фінансових ризиків на двох рівнях – на рівні кожної окремої позики та на рівні кредитного портфеля в цілому. В результаті виконання попереднього аналізу встановлено, що найпоширенішими методами оцінювання ризиків для поставленої задачі є лінійна і логістична регресії, дерева класифікації, нейронні мережі, мережа Байєса. Показано, що для підвищення ефективності прийняття об'єктивних рішень при аналізі кредитного та ринкового ризиків доцільно використовувати мережі Байєса та нечіткі нейронні мережі, які дають можливість враховувати

невизначеності ймовірнісного та амплітудного типів. Ці підходи характеризуються швидкими алгоритмами навчання та нескладною інтерпретацією накопичених знань. Такі особливості обраних підходів роблять їх одними з найбільш перспективних і ефективних інструментів моделювання і оцінювання фінансових ризиків.

2. In the work analyzed the main financial risks, the management of which is a key factor that determines the effectiveness of financial activities. Implemented an analysis of the activities of banks and other financial organizations, whose work is carried out under the influence of environmental uncertainties (market, economy, politics, etc.), a large number of variables, counterparties, individuals whose behavior can not always be predicted with acceptable accuracy. The possibility of minimizing financial risks at two levels has been considered - at the level of each individual loan and at the level of the loan portfolio as a whole. As a result of preliminary analysis, it was found that the most common methods of risk assessment for the task are linear and logistic regressions, classification trees, neural networks, Bayesian network. It is shown that to increase the efficiency of making objective decisions in the analysis of credit and market risks, it is advisable to use Bayesian networks and fuzzy neural networks, which make it possible to take into account uncertainties of probabilistic and amplitude types. These approaches are characterized by fast learning algorithms and simple interpretation of accumulated knowledge. Such features of the chosen approaches make them one of the most promising and effective tools for modeling and assessing financial risks.

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 Peter

Кваліфікація: д. т. н., 05.13.07

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 Васильвич
2. Krak Iurii

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. Корабльов Микола Михайлович
2. Korablev Mykola

Кваліфікація: д. т. н., 05.13.23

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Рецензенти

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Зайченко Олена Юріївна

2. Zaychenko Olena

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

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Мухін Вадим Євгенович

2. Mukhin Vadim Evgenovich

Кваліфікація: д. т. н., 05.13.05

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

VIII. Заключні відомості

Власне Прізвище Ім'я По-батькові голови ради Теленик Сергій Федорович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Теленик Сергій Федорович

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Т.А.