Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0410U003154

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 30-04-2010

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Омардибірова Вікторія Нурахманівна

2. Omardybirova Viktoriya Nurahmanovna

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: так

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: 08-04-2010

Спеціальність за освітою: 8.080203

Місце роботи здобувача: Київський університет туризму, економіки і права

Код за ЄДРПОУ: 22915220

Місцезнаходження: 02192, Київ-192, вул.Генерала Жмаченка, 26

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): Д 26.001.35

Повне найменування юридичної особи: Київський національний університет імені Тараса Шевченка

Код за ЄДРПОУ: 02070944

Місцезнаходження: вул. Володимирська, 60, м. Київ, Київська обл., 01033, 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: Київський національний університет імені Тараса Шевченка

Код за ЄДРПОУ: 02070944

Місцезнаходження: 01033, м. Київ, вул. Володимирська, 64

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 28.29

Тема дисертації:

1. Система підтримки прийняття рішень керуючого інвестиційним фондом.

2. Decision support system for portfolio manager of the investment fund.

Реферат/анотація:

1. Дисертація на здобуття наукового ступеня кандидата технічних наук за спеціальністю 01.05.04 - системний аналіз і теорія оптимальних рішень. - Київський національний університет імені Тараса Шевченка, Київ, 2010. Дисертаційна робота присвячена побудові системи підтримки прийняття рішень керуючого інвестиційним фондом. Проаналізовано етапи діяльності керуючого інвестиційним фондом по створенню портфеля фонду, розроблено структуру системи підтримки прийняття рішень, яка складається з п'яти підсистем. В рамках відповідних підсистем були розроблені: багатовимірна модель класифікації акцій; модифікація побудови оптимального інвестиційного портфеля за Марковицем; модель прогнозування поведінки портфеля з використанням RFT-перетворювачів. Опис підсистем, що складають систему підтримки прийняття рішень, формалізовано у вигляді алгоритмів. Алгоритми моделювання поведінки інвестиційного портфеля на горизонті інвестування методом Монте-Карло допускають реалізацію з використанням паралельних

обчислень на відео картах та технології CUDA компанії Nvidia. Створену систему підтримки прийняття рішень реалізовано у вигляді програмного продукту з використанням середовищ розробки Microsoft Visual Studio 2005, Borland C++ Builder 5.0 і мов програмування C, C++ і C#. Він складається з окремих Windows-додатків, кожен з яких відповідає одній з п'яти підсистем, що складають систему підтримки прийняття рішень. Для перевірки ефективності створеної системи підтримки прийняття рішень було проведено модельний експеримент на даних американського фондового ринку. Ключові слова: система підтримки прийняття рішень, інвестиційний фонд, класифікація, дифузійні процеси, метод Монте-Карло, RFT-перетворювачі, технологія CUDA, оптимальний портфель.

2. Thesis for candidate's degree in technical sciences in specialty 01.05.04 - system analysis and decision making theory. - Taras Shevchenko National University of Kyiv, Kyiv, 2010. Research on creation of decision support system for portfolio manager was conducted. As a result corresponding decision support system was created. Investment fund portfolio creation process was studied. Corresponding structure for decision support system was created. It consists from 5 subsystems. Multidimensional stocks classification model, modification of Markovits approach to optimal portfolio construction, diffusion model parameters estimation, model for forecasting of future portfolio behavior based on RFT-transformations were developed. Description of relevant subsystems which comprise decision support system was formalized in the form of algorithms. Monte-Carlo algorithms for portfolio simulation allows to be implemented with usage of parallel GPU calculations and Nvidia's CUDA technology. Researched decision support system was developed in the form of software developed under Microsoft Visual Studio 2005, Borland C++ Builder 5.0 IDEs and written in C, C++ and C

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. Донченко Володимир Степанович

2. Donchenko Vladimir Stepanovich

Кваліфікація: д.ф.-м.н., 01.05.02

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. Волошин Олексій Федорович
2. Волошин Олексій Федорович

Кваліфікація: д.т.н., 05.13.16

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. Подладчіков Володимир Миколайович
2. Подладчіков Володимир Миколайович

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

Рецензенти

VIII. Заключні відомості

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