Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0518U000043

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 07-02-2018

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Хохлов Валентин Юрійович
2. Khokhlov Valentyn Yuriiovych

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: 29-01-2018

Спеціальність за освітою: 8.080404

Місце роботи здобувача:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д 26.006.07

Повне найменування юридичної особи: Державний вищий навчальний заклад "Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана"

Код за ЄДРПОУ: 02070884

Місцезнаходження: проспект Перемоги, 54/1, м. Київ, Київська обл., 03057, 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: 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, 06.35.51

Тема дисертації:

1. Моделювання портфелів цінних паперів в умовах глобальної економічної нестабільності
2. Portfolio modeling under the global uncertainty conditions

Реферат/анотація:

1. Дисертація присвячена розробці нових та удосконаленні існуючих методологічних підходів до управління портфелем цінних паперів. Її метою є створення економіко-математичного інструментарію, який підвищує ефективність управління портфелем в сучасних економічних умовах. Розроблено методологічний підхід до оптимізації структури портфеля за нелінійними критеріями та побудовано моделі оптимізації за нормами Шарпа, Трейнора, інформаційним коефіцієнтом, VaR, CVaR. Запропоновано методологію оптимізації структури портфеля, що стежить за бенчмарком, побудовано моделі оптимізації за критеріями TEV, TE2, кореляцією з бенчмарком. Удосконалено методологічні засади оцінювання ризику за наявності "важких хвостів", для чого обґрунтовано застосування розподілів Стьюдента та Лапласа. Побудовано багатокритеріальні моделі імунізації портфеля облігацій та хеджування за допомогою опціонів. Розроблено підхід до врахування людського капіталу у фінансовому плануванні.

2. The thesis is dedicated to the development and improvement of methodological approaches to the portfolio management. Its objective is to create an economic-mathematical toolset that increases the portfolio management efficacy under the current economic conditions. A new methodological approach to the non-linear portfolio optimization is developed, and the relevant portfolio optimization models with respect to the Sharpe ratio, Treynor ratio, information ratio, VaR, CVaR are built. A tracking portfolio optimization methodology is proposed, and the relevant portfolio optimization models with respect to TEV, TE2, and correlation with the benchmark are built. Methodological framework of risk evaluation is improved to account for the "fat tails", for which the usage of the Student's t-distribution and the Laplace distribution is suggested. Multi-criteria models for the bond portfolio immunization and options hedging are built. An approach to account for human capital in the financial planning is developed.

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. Матвійчук Андрій Вікторович
2. Matviichuk Andrii Viktorovych

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. Матвійчук Андрій Вікторович

2. Matviichuk Andrii Viktorovych

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. Лисенко Юрій Григорович

2. Лисенко Юрій Григорович

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.03, 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. Лисенко Юрій Григорович

2. Лисенко Юрій Григорович

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.03, 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. Клебанова Тамара Семенівна
2. Клебанова Тамара Семенівна

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. Клебанова Тамара Семенівна
2. Клебанова Тамара Семенівна

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. Черняк Олександр Іванович
2. Черняк Олександр Іванович

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. Черняк Олександр Іванович
2. Черняк Олександр Іванович

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	Вітлінський Вальдемар Володимирович
Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні	Вітлінський Вальдемар Володимирович
Відповідальний за підготовку облікових документів	
Реєстратор	

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Т.А.