

# Облікова картка дисертації

## I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0415U000039

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 12-01-2015

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:



## II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Мороз Анна Григорівна

2. Moroz Anna Grygorivna

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: ні

Шифр наукової спеціальності: 01.01.05

Назва наукової спеціальності: Теорія ймовірностей і математична статистика

Галузь / галузі знань: Не застосовується

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 22-12-2014

Спеціальність за освітою: 8.04020101

Місце роботи здобувача: ТОВ "Де-Три Консалтинг"

Код за ЄДРПОУ: 38449379

Місцезнаходження: 01042, м. Київ, Філатова, 10-А, оф. 2/14

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

### **III. Відомості про організацію, де відбувся захист**

**Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради):** Д 26.001.37

**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:** 27.43.15

**Тема дисертації:**

1. Задача оптимальної зупинки у моделі Леві
2. Optimal stopping problem in Levy model

**Реферат:**

1. В дисертації розглянуто задачу оптимальної зупинки у моделі Леві для американських опціонів. Досліджено властивості функції вартості і моделі Леві. Для опціону продажу показано, що оптимальний момент зупинки є моментом першого перетину певного рівня. Вивчається асимптотична поведінка функції вартості при необмеженому розширенні часового горизонту. Наведені достатні умови, за яких область оптимальної зупинки є непорожньою, та умови, за яких вона має порогову структуру. Доведено збіжність моментів виходу зі смуги для розв'язків системи стохастичних диференціальних рівнянь зі стрибками.
2. The thesis is devoted to the optimal stopping problem in Levy models for American type contingent claims. The properties of value functions in Levy model are studied. It is shown that for the put option in Levy models the optimal stopping time is the first time when the price process reaches a certain level. The behavior of value function is studied, when the maturity diverges to infinity. Sufficient conditions for non-emptiness and for

threshold structure of optimal stopping region are provided. For solutions stochastic differential equations with jumps a convergence result is established and it is proved that the hitting times of certain sets converge as well.

**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 ОПВ:**

**Впровадження результатів дисертації:**

**Зв'язок з науковими темами:**

## **VI. Відомості про наукового керівника/керівників (консультанта)**

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові:**

1. Шевченко Георгій Михайлович
2. Shevchenko Georgiy Mykhailovych

**Кваліфікація:** к.ф.-м.н., 01.01.05

**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. Єлейко Ярослав Іванович
2. Єлейко Ярослав Іванович

**Кваліфікація:** д.ф.-м.н., 01.01.05

**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. Арясова Ольга Вікторівна

2. Арясова Ольга Вікторівна

**Кваліфікація:** к.ф.-м.н., 01.01.05

**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**

Городній Михайло Федорович

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові  
головуючого на засіданні**

Городній Михайло Федорович

**Відповідальний за підготовку  
облікових документів**

**Реєстратор**

**Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є  
відповідальним за реєстрацію наукової  
діяльності**



Юрченко Т.А.