Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0403U000357

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 06-02-2003

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Харченко Алла Олександрівна
2. Kharchenko Alla Olexandrivna

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: так

Шифр наукової спеціальності: 08.03.02

Назва наукової спеціальності: Економіко-математичне моделювання

Галузь / галузі знань: Не застосовується

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 16-01-2003

Спеціальність за освітою: 0102

Місце роботи здобувача: Національний технічний університет "Харківський політехнічний інститут"

Код за ЄДРПОУ: 02071180

Місцезнаходження: 61001, м. Харків, вул. Кирпичова, 2

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): К 64.055.02

Повне найменування юридичної особи:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

IV. Відомості про підприємство, установу, організацію, в якій було виконано дисертацію

Повне найменування юридичної особи: Національний технічний університет "Харківський політехнічний інститут"

Код за ЄДРПОУ: 02071180

Місцезнаходження: 61001, м. Харків, вул. Кирпичова, 2

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

Тема дисертації:

1. Моделювання процессів прийнття рішень в системі інвестиційного менеджменту

2. Modeling of decision-making processes in a system of investment management

Реферат/анотація:

1. Об'єкт дослідження - процес інвестиційного менеджменту фінансово-кредитного інституту. Мета дослідження - розробка комплексу взаємопов'язаних економіко-математичних моделей, які забезпечують прийняття ефективних рішень у системі інвестиційного менеджменту фінансово-кредитного інституту. Методи дослідження: системний аналіз, теорія інвестиційного менеджменту, теорія прийняття рішень, методи експертного, багатовимірного регресійного аналізу, теорія прогнозування, теорія імовірностей і математичної статистики. Теоретичний результат - розроблені механізми та підходи до моделювання процесів прийняття рішень в системі інвестиційного менеджменту фінансової установи. Прикладна цінність обумовлена розробкою комплексу моделей і методів прийняття рішень в системі інвестиційного менеджменту, що дозволяють спростити процедуру їхнього прийняття з урахуванням динамічного характеру зовнішнього середовища та зменшити ризики інвестиційної діяльності. Наукова новизна: розроблено модель оцінки фінансового стану емітента,яка базується на байєсовій експертній системі та модель його

прогнозування. Ці моделі враховують динаміку фінансового стану емітента, що істотно поліпшує ефективність прийнятих рішень. Розроблено імовірнісну модель формування інвестиційного портфеля, що дозволяє оцінити та зменшити рівень його ризику. Розроблено модель, яка з урахуванням динаміки фінансових потоків формує ефективну структуру портфеля на певний заданий горизонт. Доповнено концепцію створення комплексу економіко-математичних моделей підтримки прийняття рішень в інвестиційному менеджменті, яка дозволяє підвищити ефективність інвестиційної діяльності. Удосконалено моделі оцінки та прогнозування інвестиційної привабливості цінних паперів з урахуванням динаміки їх характеристик, які дозволяют сформувати сукупність привабливих цінних паперів і збільшити прибутковість та зменшити ризики портфеля.

2. The object of a research - is a process of investment management of an investment company. The purpose of research - is mining of a complex of interdependent economic-mathematical models ensuring acceptance of effective solutions in a system of investment management. The methods of research: systems analysis, theory of investment management, decision theory, methods of the expertal, multidimensional regression analysis, theory of forecasting, probability theory and mathematical statistics. Idealized outcome - the gears and approaches to simulation of decision-making processes in a system of investment management of financial institutions are designed. The applied value is conditioned by mining of a complex of models and methods of decision making in a system of investment management permitting to simplify a procedure of decision making with allowance for of dynamic nature of environment and to lower hazards of investment activity. Scientific novelty: the model of an estimation of a financial conditionof the emitter is offered, which one bases on the Bayes consulting model and model of its forecasting. These models allow for dynamics of a financial condition of the emitter, what essentially increases efficiency of the received solutions. The probabilistic model of formation of an investment briefcase is offered, that allows to evaluate and to reduce a level of its risk. The model is designed, which one with allowance for of dynamics of financial flows reshapes effective frame of a briefcase on given temporary horizont. Is supplemented the concept of creation of a complex economy-mathematics models for support of decision making in investment management, which one allows to increase efficiency of investment activity. The models of an estimation and forecasting of investment attractiveness of valuable papers with allowance for dynamics with the count of their characteristics are advanced, which one allow to form set of attractive valuable papers, to increase profitability and to reduce hazards of a briefcase.

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. Заруба Виктор Яковлевич

2. Zaruba Vyktor Yakovlevych

Кваліфікація: д.е.н., 08.03.02

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. Вітлінський Вальдемар Володимирович

2. Вітлінський Вальдемар Володимирович

Кваліфікація: д.е.н., 08.03.02

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. Раєвнєва Олена Валентінівна

2. Раєвнєва Олена Валентінівна

Кваліфікація: к.е.н., 08.00.05

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 Гриньова В.М.

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Гриньова В.М.

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності Юрченко Т.А.