

# Облікова картка дисертації

## I. Загальні відомості

**Державний обліковий номер:** 0405U004055

**Особливі позначки:** відкрита

**Дата реєстрації:** 03-11-2005

**Статус:** Захищена

**Реквізити наказу МОН / наказу закладу:**



## II. Відомості про здобувача

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові:**

1. Бурма Тетяна Григорівна

2. Burma Tetiana Grygorivna

**Кваліфікація:**

**Ідентифікатор ORCID ID:** Не застосовується

**Вид дисертації:** кандидат наук

**Аспірантура/Докторантура:** ні

**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:** 11-10-2005

**Спеціальність за освітою:** 7.050104

**Місце роботи здобувача:** Гуманітарний університет "Запорізький інститут державного та муніципального управління"

**Код за ЄДРПОУ:** 19278502

**Місцезнаходження:** 69002, м. Запоріжжя, вул. Жуковського, буд.70-б

**Форма власності:**

**Сфера управління:** Держадміністрація

**Ідентифікатор ROR:** Не застосовується

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

**Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради):** Д 08.051.03

**Повне найменування юридичної особи:** Дніпровський національний університет імені Олеся Гончара

**Код за ЄДРПОУ:** 02066747

**Місцезнаходження:** проспект Гагаріна, 72, м. Дніпро, Дніпропетровський р-н., Дніпропетровська обл., 49010, 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:** Дніпропетровський національний університет імені Олеся Гончара

**Код за ЄДРПОУ:** 02066747

**Місцезнаходження:** 49010, м. Дніпро, пр. Гагаріна 72

**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 процесів інвестування та управління потоками платежів для фінансових інструментів з фіксованим доходом
2. Modeling of investing and management processes by the payment flows for financial instruments with the fixed income

**Реферат:**

1. Об'єкт: процеси інвестування та управління потоками платежів для фінансових інструментів із фіксованим доходом у сучасних умовах ринкової економіки України. Мета: розробка та обґрунтування теоретичних, методичних і практичних засад економіко-математичного моделювання процесів інвестування та управління потоками платежів для фінансових інструментів з фіксованим доходом в умовах сучасної ринкової економіки України. Методи: економіко-математичне моделювання, абстрактно-логічний, економіко-статистичний, монографічний. Результати: узагальнено існуючі підходи та розроблено нові економіко-математичні моделі для обґрунтування інвестиційних рішень щодо фінансових інструментів з

фіксованим доходом. Новизна: розроблено узагальнену модель оптимізації портфеля облігацій на основі сценарного підходу; дано визначення потоку платежів, запропоновано його ормалізований опис та класифікацію; удосконалені методичні підходи до аналізу базових характеристик потоків платежів фінансових інструментів з фіксованим доходом; дістала подальшого розвитку вартісна оцінка облігацій. Сфера впровадження: суб'єкти вторинного фондового ринку, вузи.

2. Object: processes of investment and payment flows control for financial instruments with a fixed income in the current conditions of market economy in Ukraine. Purpose: developing and grounding theoretical, methodic and practical bases of economic-mathematical modeling of investment and payment flows control processes for financial instruments with a fixed income in the current conditions of market economy in Ukraine. Methods: economic-mathematical modeling as well as abstract-logic, economic-statistical and monographic methods. Results: existing approaches have been generalized; new economic-mathematical models have been developed for grounding investment solutions as for financial instruments with a fixed income. Novelty: general model of bonds portfolio optimization on the basis of scenario approach has been developed; the definition of payments flow has been given, its formalized description and classification have been suggested; methodic approaches to analyzing basic characteristics of payments flows for financial instruments with a fixed income have been improved; value estimation of bonds has been further worked out. Implementation sphere: subjects of the secondary stock market, institutions of higher education.

**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. Марюта Олександр Микитович

2. Alexander Maryuta

**Кваліфікація:** д.т.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. Кадієвський Володимир Андрійович
2. Кадієвський Володимир Андрійович

**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. Ульяновченко Олександр Вікторович
2. Ульяновченко Олександр Вікторович

**Кваліфікація:** к.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

### **Рецензенти**

## **VIII. Заключні відомості**

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові  
голови ради**

Тимошенко Лідія Михайлівна

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

Тимошенко Лідія Михайлівна

**Відповідальний за підготовку  
облікових документів**

**Реєстратор**

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



Юрченко Т.А.