

Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0405U004126

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 08-11-2005

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:



II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Рутицька Владислава Валеріївна

2. Rutitskaja Vladislava Valerievna

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: 27-10-2005

Спеціальність за освітою: 8.080201

Місце роботи здобувача: 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

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: 27.29.17

Тема дисертації:

1. Розробка та системний аналіз математичних моделей для розв'язування прикладних задач інвестиційного менеджменту.
2. Mathematical models development and the system analysis for the decision-making process of applied problems in investment management.

Реферат:

1. В дисертації розглядаються проблеми побудови та дослідження математичних моделей параметрично заданих динамічних систем з неповною інформацією про стан системи в термінах теорії інвестиційного менеджменту. Проведений аналіз даних моделей, досліджено нові постановки статичних та динамічних фінансових задач, отримано необхідні умови оптимальності та розроблено алгоритми для їх розв'язування. Побудовано та науково обґрунтовано динамічну математичну модель формування вартості складових портфеля цінних паперів. Розглянуто практичні задачі моделювання оптимального інвестиційного портфеля, ефективної диверсифікації і моніторингу. Запропонована методика була застосована для розв'язання широкого кола задач прикладного фінансового аналізу та оптимізації діяльності інвестора на

фондовому ринку.

2. The dissertation covers problems of construction and research of mathematical models and parametric dynamic systems with incomplete information about a condition of system in terms of the theory of investment management. On the basis of methods of the system analysis of mathematical models new statements of a wide spectrum of static and dynamic problems of financial management are formulated and investigated, necessary conditions of an optimality are received and algorithms of search of optimum decisions are developed. Work performs the system analysis of the given models, new statements and formulation of static and dynamic financial problems are investigated, necessary conditions of optimality are received and algorithms of their definition are developed. The dynamic mathematical model of the portfolio of securities cost formation is deduced and scientifically proved. Practical problems of modeling of an optimum investment portfolio structure, effective diversification and securities price monitoring are considered. The offered technique has been applied to the decision-making problems of the applied financial analysis and investors' activity optimization in the share market.

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. Гаращенко Ф.Г.

2. Garaschenko F.G.

Кваліфікація: д.т.н., 05.13.02

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. Бідюк П.І.
2. Бідюк П.І.

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

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Верченко П.І.
2. Верченко П.І.

Кваліфікація: к.ф.-м.н., 01.01.09

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 О.Г.

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

Наконечний О.Г.

