Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0408U003336

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 08-07-2008

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Федоров Євген Григорович
2. Fedorov Evgen Grygorovich

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: так

Шифр наукової спеціальності: 05.13.06

Назва наукової спеціальності: Інформаційні технології

Галузь / галузі знань: Не застосовується

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 11-06-2008

Спеціальність за освітою: 8.080401

Місце роботи здобувача: Харківський національний університет радіоелектроніки

Код за ЄДРПОУ: 02071197

Місцезнаходження: 61166, м. Харків, пр. Науки, 14

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 64.052.01

Повне найменування юридичної особи: Харківський національний університет радіоелектроніки

Код за ЄДРПОУ: 02071197

Місцезнаходження: проспект Науки, 14, м. Харків, Харківський р-н., Харківська обл., 61166, 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: Харківський національний університет радіоелектроніки

Код за ЄДРПОУ: 02071197

Місцезнаходження: 61166, м. Харків, пр. Науки, 14

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 50.49.37

Тема дисертації:

1. Інформаційна технологія прогнозування ризику в інформаційно-управляючих системах
2. Information technology of risk forecasting in information management systems

Реферат/анотація:

1. Дисертаційна робота присвячена розробці інформаційної технології прогнозування ризику в інформаційно-управляючих системах. Вперше запропоновано метод аналізу та синтезу функціональної моделі прогнозування ризику в ІУС, який включає етап вибору найбільш ефективної моделі прогнозування ризику в залежності від статистичних характеристик вхідних даних, етап прогнозування значних змін ризику та етап корегування прогнозу ризику в залежності від помилки прогнозу. Удосконалено метод прогнозування ризику Value-at-Risk шляхом корегування множника стандартного відхилення в залежності від рівня помилки прогнозу. Удосконалено метод оцінки ефективності методів і моделей прогнозування ризику в ІУС шляхом використання запропонованого критерію відносного рівня втрат. Отримала подальший розвиток концептуальна модель прогнозування ризику в ІУС шляхом урахування факторів, які призводять до значних змін ризику. Наукові результати, отримані в дисертаційній роботі, знаходять практичне застосування при прогнозуванні ризику вІУС підприємств, банків, фінансових та інвестиційних компаній.

2. Dissertation work is dedicated to development the information technology of risk forecasting in Information Management Systems (IMS). The method of analysis and synthesis of risk forecasting functional model in IMS is first developed. This method includes stages: stage of choice the most effective model of risk forecasting depending on statistical characteristics of the initial data, a prediction stage of risk significant changes and a stage of risk forecast correction depending on a forecast error, that allows to provide the unexceeding preselected level of losses set by a user. The model of significant changes of risk is improved. This model includes risk factors which result in occurrence of significant changes of a risk level. The method of currency risk forecasting Value-at-Risk is improved. This method based on a risk forecast correction depending on a forecast error. Taken further development the method of risk forecasting methods and models efficiency estimation. Scientific results, got in dissertation work, find practical application at risk forecasting in IMS of banks, financial and investment companies.

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. Шамша Борис Володимирович
2. Shamsha Boris Vladimirovich

Кваліфікація: к.т.н., 05.13.01

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. Федорович Олег Євгенович

2. Федорович Олег Євгенович

Кваліфікація: д.т.н., 05.13.06

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. Асєєв Георгій Георгійович

2. Асєєв Георгій Георгійович

Кваліфікація: д.т.н., 05.25.05

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 Бондаренко Михайло Федорович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Бондаренко Михайло Федорович

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Т.А.