Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0507U000681

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 14-12-2007

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Камінський Андрій Борисович

2. Kaminsky Andriy Borysovych

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: доктор наук

Аспірантура/Докторантура: ні

Шифр наукової спеціальності: 08.00.11

Назва наукової спеціальності: Математичні методи, моделі та інформаційні технології в економіці

Галузь / галузі знань: Не застосовується

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 30-11-2007

Спеціальність за освітою: 01.01

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 26.001.13

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: 06.35.51

Тема дисертації:

1. Економіко-математичне моделювання фінансових ризиків.

2. Economic and Mathematical Modeling of Financial Risks.

Реферат/анотація:

1. У дисертації розроблено теоретико-методологічні положення економіко-математичного моделювання фінансових ризиків, розвинуто інструментарій їх аналізу, вимірювання та моделювання, побудовано та досліджено економіко-математичні моделі управління ризиком. У дисертації обґрунтовано роль процедур вимірювання та рейтингової оцінки фінансових ризиків. Досліджено вимірювання фінансових ризиків у межах різних концептуальних підходів та запропоновано низку нових мір ризику. Розроблено логіку та інструментарій стохастичного моделювання фінансових ризиків. Змодельовано асиметрію та екстремальні збитки в межах різних підходів до їх вимірювання. Вперше запропоновано методику врахування скосу та ексцесу за допомогою функції Грама-Шарльє при моделюванні величини умовного капіталу-під-ризиком. Запропоновано низку методик розрахунку величини "економічного капіталу" фінансових інститутів. Досліджено логіку рейтингового моделювання фінансових ризиків та розвинуто експертний підхід до

рейтингового оцінювання. Вперше запропоновано нечітко-множинний підхід до моделювання фінансових ризиків із спеціальною агрегацією окремих функцій належності за допомогою копул. Побудовано систему рейтингових моделей ліквідності портфеля акцій.

2. The theoretical and methodological positions of economic and mathematical modeling of financial risks are elaborated in the thesis, tools of their analysis, measuring and modeling are developed, and the numbers of models of optimization of risk are built. The role of measuring and rating estimation within framework of financial risks modeling is presented. The different conceptual approaches for risk measuring are investigated and some new measures of risk are offered. The logic and tools of stochastic modeling of financial risks are determined. The asymmetry and extreme losses are modeled within frameworks of different approaches for risk measuring. The methods of calculation of the "economic capital" size for financial institutes are developed. Rating model of financial risks logically applicable is investigated and expert approach to the rating evaluation is presented. Fuzzy-set approach for financial risks modeling with special aggregation of membership functions based on copula is used. The system of ratings models of liquidity of portfolio equities is created grounds exclusively on "distance" information.

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. Вітлінський Вальдемар Володимирович
2. Vitlinsky Valdemar Volodymyrovych

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.11

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. Христіановський Вадим Володимирович
2. Христіановський Вадим Володимирович

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.11

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. Ковальчук Костянтин Федорович
2. Ковальчук Костянтин Федорович

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.11

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. Лук'яненко Ірина Григорівна
2. Лук'яненко Ірина Григорівна

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.11

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 Базилевич В.Д.

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Базилевич В.Д.

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

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