Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0418U003467

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 30-10-2018

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Зражевська Наталія Григорівна
2. Zrazhevska Nataliia Grygorivna

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: 16-10-2018

Спеціальність за освітою: математика

Місце роботи здобувача: ТОВ НьюГраунд

Код за ЄДРПОУ: 33296552

Місцезнаходження: вул. Княжий Затон, 16-А, оф.99, м. Київ, Київ, 02068, Україна

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д 26.002.03

Повне найменування юридичної особи: Кафедра системного проектування Національного технічного університету України "Київський політехнічний інститут імені Ігоря Сікорського"

Код за ЄДРПОУ: 25408067

Місцезнаходження: пр.Перемоги,37,корп.26, м. Київ, Київ, 03056, 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: Науково-навчальний комплекс Інститут прикладного системного аналізу НАН України та Міносвіти України

Код за ЄДРПОУ: 25408967

Місцезнаходження: 02056 Київ, пр.Перемоги, 37, корп. 35, м. Київ, Київ, 02056, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 28.29

Тема дисертації:

1. Методи і моделі прогнозування мір динамічних фондових ризиків

2. Methods and models of dynamic stock risk measures forecasting

Реферат/анотація:

1. Дисертаційна робота полягає в розробці системного підходу до моделювання і прогнозування мір ризиків VaR і CVaR, які є найпоширенішими мірами, що використовуються при оцінюванні ризиків фондових бірж. 21 В рамках запропонованого підходу проведено системний аналіз сучасних методів оцінювання мір VaR і CVaR для статичних і динамічних ризиків, результати аналізу сформульовано у вигляді класифікаційних схем. Для врахування властивостей волатильності та сильної залежності, що є характерними для фінансових рядів, для прогнозування VaR і CVaR запропоновано новий Метод Згладжування Автокореляційної Функції. Для прогнозування дисперсії часового ряду модель FIGARCH зводиться до моделі авторегресії нескінченного порядку для квадратів процесу. Для знаходження коефіцієнтів авторегресії розв'язується редукована система ЮлаУокера. Регресійне рівняння для автокореляційної функції, що ґрунтується на означенні сильної залежності, використовується для знаходження оцінок автокореляції. Для уточнення оцінок

автокореляційних коефіцієнтів запропоновано оптимізаційну процедуру. Всі етапи системного підходу апробовано на часових рядах, що описують логарифмічну дохідність акцій фондових бірж.

2. The thesis is the development of a systematic approach for obtaining the forecast estimates of risk measures VaR and CVaR, the popular measures in assessing of financial risks, primarily stock market risks. In the framework of the proposed approach, a systematic analysis of current methods for VaR and CVaR evaluating is carried out, the results of the analysis are formulated in the form of classification schemes. To take into account the properties of volatility and long range dependence, which are typical for financial series, a new method of smoothing of the autocorrelation function is proposed. For volatility forecasting FIGARCH model is reduced to the AR model of infinite order for the squares of the process. The reduced system of Yule-Walker equations is solved to find the autoregression coefficients. The regression equation for the autocorrelation function based on the definition of the long-range dependence is used to get the autocorrelation estimates. An optimization procedure is proposed to specify the estimates of autocorrelation coefficients. All stages of the system approach are applied to the time series of the indeces of the various stock exchanges.

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. Панкратова Наталія Дмитрівна
2. Pankratova Nataliia

Кваліфікація: д. т. н., 01.02.04

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. Андрійчук Олег Валентинович
2. Andriychuk Oleg

Кваліфікація: к. т. н., 01.05.04

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. Міхайленко Віктор Мефодійович
2. Mikhailenko Viktor

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

Рецензенти

VIII. Заключні відомості

Власне Прізвище Ім'я По-батькові голови ради Згуровський Михайло Захарович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Згуровський Михайло Захарович

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Т.А.