# Облікова картка дисертації

## I. Загальні відомості

**Державний обліковий номер:** 0412U000163

**Особливі позначки:** відкрита

**Дата реєстрації:** 30-01-2012

**Статус:** Захищена

**Реквізити наказу МОН / наказу закладу:**

## II. Відомості про здобувача

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові:**

1. Юхновський Юрій Васильович

2. Yukhnovskiy Yuriy Vasilyovych

**Кваліфікація:**

**Ідентифікатор ORCID ID:** Не застосовується

**Вид дисертації:** кандидат наук

**Аспірантура/Докторантура:** так

**Шифр наукової спеціальності:** 01.01.05

**Назва наукової спеціальності:** Теорія ймовірностей і математична статистика

**Галузь / галузі знань:** Не застосовується

**Освітньо-наукова програма зі спеціальності:** Не застосовується

**Дата захисту:** 23-01-2012

**Спеціальність за освітою:** 7.080101

**Місце роботи здобувача:** Закрите акціонерне товариство "АЛЬФА БАНК"

**Код за ЄДРПОУ:** 23494714

**Місцезнаходження:** 01025,Україна,Київ-25,вул.Десятинна,4/6

**Форма власності:**

**Сфера управління:** Національний банк України

**Ідентифікатор ROR:** Не застосовується

## III. Відомості про організацію, де відбувся захист

**Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради):** Д 26.001.37

**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:** 27.43.15

**Тема дисертації:**

1. Функціональні граничні теореми для стохастичних інтегралів по семімартингалах та їх застосування до задач фінансового інвестування.

2. Functional limit theorems for stochastic integrals with respect to semimartingales and their application to the problems of financial investment.

**Реферат/анотація:**

1. Дисертаційна робота присвячена дослідженню умов, що забезпечують збіжність стохастичних інтегралів по семімартингалах в термінах будь-якого фіксованого розкладу семімартингалу на мартингал та процес обмеженої варіації. Отримані функціональні граничні теореми застосовано для розв'язання задач фінансової математики, що стосуються граничної поведінки капіталів, платіжних зобов'язань та стратегій, зокрема, на узагальненому ринку Блека-Шоулса з випадковими зносом та волатильністю. Отримано рекурентне зображення стратегій, що мінімізують локальний квадратичний ризик в багатовимірний моделі фінансового ринку з дискретним часом. Досліджено граничну поведінку таких стратегій.

2. The Thesis is devoted to the investigation of conditions ensuring convergence of stochastic integrals with respect to the semimartingales. The conditions are formulated in terms of any fixed decomposition of semimartingale on a martingale and a process of bounded variation. The functional limit theorems are applied to the problem of limit behavior of capitals, contingent claims and the strategies. Recurrent relations for the strategies minimizing local quadratic risk in the multidimensional models of financial market with discrete time are obtained.

**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. Мішура Юлія Степанівна

2. Mishura Yuliya Stepanivna

**Кваліфікація:** д.ф.-м.н., 01.01.05

**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. Єлейко Ярослав Іванович

2. Єлейко Ярослав Іванович

**Кваліфікація:** д.ф.-м.н., 01.01.05

**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. Кнопова Вікторія Павлівна

2. Кнопова Вікторія Павлівна

**Кваліфікація:** к.ф.-м.н., 01.01.05

**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** Городній Михайло Федорович

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

**Відповідальний за підготовку облікових документів**

**Реєстратор**

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




Юрченко Т.А.