Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0415U005604

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 26-10-2015

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Карпуша Марина Василівна
2. Karpusha Maryna Vasylivna

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: так

Шифр наукової спеціальності: 01.05.02

Назва наукової спеціальності: Математичне моделювання та обчислювальні методи

Галузь / галузі знань: Не застосовується

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 28-09-2015

Спеціальність за освітою: 7.04030102

Місце роботи здобувача: Сумський державний університет

Код за ЄДРПОУ: 05408289

Місцезнаходження: 40007, м. Суми, вул. Римського-Корсакова 2

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: Сумський державний університет

Код за ЄДРПОУ: 05408289

Місцезнаходження: 40007, м. Суми, вул. Римського-Корсакова 2

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 28.17.19

Тема дисертації:

1. Моделювання та ідентифікація в задачах оптимізації портфеля та керування ризиками.
2. Modeling and identification problems of portfolio optimization and risk management. -

Реферат:

1. У дисертації розроблені нові методи прогнозування ціни активу, що використовуються для параметричної ідентифікації в задачах оптимізації інвестиційного портфеля. Запропоновано нові дискретно-неперервні моделі з двозначними та тризначними фіктивними змінними. Дані моделі враховують попередній аналіз даних на стаціонарність та нестаціонарність. При прогнозування даних моделей використовуються множинні логіт- та пробіт-моделі, що дозволяють визначити найбільш ймовірний варіант зміни ціни та отримати якісні прогнозні властивості. Процедура верифікації дозволяє: виконати всі передумови використання методу найменших квадратів для оцінки невідомих параметрів даної моделі; отримати якісні імітаційні властивості; знаходити прогнозні значення, що є нечутливими до незначних змін вхідної інформації. Дані моделі передбачають ітераційну процедуру, що дозволяє отримати математичну модель, яка найкращим чином описує досліджувані часові ряди. Досліджено доцільність використання прогнозів ціни активу, отриманих за допомогою дискретно-неперервних моделей, для параметричної ідентифікації в

задачах оптимізації інвестиційного портфеля. Набули подальшого розвитку методи, що базуються на побудові різних функціональних форм та дослідженні ефектів другого роду. Отримані підходи дозволяють модифікувати поставлену задачу оптимізації, що збільшує адекватність отриманих розв'язків.

2. A new discrete continuous model with double-digit and three-digit dummies variables was introduced. These models have the following features. They involve a preliminary analysis of data on stationary and nonstationarity. The pretreatment procedures are done for income data, splitting time series into classes and classifying them (TS or DS class). The TS class includes series that are stationary relatively to the deterministic trend, so the trend component is allocated for them. The DS class consists of rows with stochastic trend being present (possibly with a deterministic trend). These numbers are reduced to fixed by k-fold differentiation. These two classes require to be simulated with different methods. Explore different effects availability in the time series data. The econometric modeling was done in respect to the fact that both continuous and discrete effects could be observed. Also, neither time moments, when regresants values bounces nor magnitude of these bounces are known. Therefore, the model and the procedure of it is construction is such that the parameters of the model and discrete effects are identified by iteration. The interaction of continuous and discrete components adjusts regresant to adequate reflection of the real process. Forecasting models use logit-models and probit-models to determine the most likely option in price changing and to get high predictive properties.

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. Назаренко Олександр Максимович

2. Nazarenko Oleksandr Maksymovych

Кваліфікація: к.ф.-м.н., 01.05.02

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 Петро Іванович
2. Бідюк Петро Іванович

Кваліфікація: д.т.н., 05.01.03

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. Кулян Вітор Романович
2. Кулян Вітор Романович

Кваліфікація: к.т.н., 05.13.16

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	Закусило Олег Каленикович
Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні	Закусило Олег Каленикович
Відповідальний за підготовку облікових документів	
Реєстратор	
Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності	Юрченко Т.А.