Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0406U005038

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 20-12-2006

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Єлейко Тарас Ярославович

2. Eleyko Taras Yaroslavovych

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: 24-11-2006

Спеціальність за освітою: 7.080202

Місце роботи здобувача: Інститут кібернетики ім. В.М.Глушкова НАН України

Код за ЄДРПОУ: 05417176

Місцезнаходження: 03680,МСП,м.Київ-187,пр.Академіка Глушкова, 40

Форма власності:

Сфера управління: Національна академія наук України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д 26.194.02

Повне найменування юридичної особи: Інститут кібернетики імені В.М. Глушкова Національної академії наук України

Код за ЄДРПОУ: 05417176

Місцезнаходження: проспект Академіка Глушкова, 40, м. Київ, Київська обл., 03187, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Національна академія наук України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

IV. Відомості про підприємство, установу, організацію, в якій було виконано дисертацію

Повне найменування юридичної особи: Інститут кібернетики ім. В.М.Глушкова НАН України

Код за ЄДРПОУ: 05417176

Місцезнаходження: 03680,МСП,м.Київ-187,пр.Академіка Глушкова, 40

Форма власності:

Сфера управління: Національна академія наук України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 28.19.15

Тема дисертації:

1. Розробка методів прискореного моделювання та стохастичної оптимізації в корпоративних моделях.

2. Developing methods of accelerated simulation and stochastic optimization for corporate models.

Реферат/анотація:

1. Дисертацію присвячено проблемі стохастичної оптимізації корпоративних моделей та дослідженню з їхньою допомогою відкритої на цей час проблеми відшукання оптимальної динамічної структури капіталу компаній. Основний акцент у даній роботі зроблено на проблемі відшукання оптимальної стратегії управління та зупинки для специфічного класу обривних керованих марковських процесів, які добре описують еволюцію виробничих компаній спираючись на внутрішні показники їхньої діяльності. При цьому отримано достатні умови існування та розроблено рівномірно збіжні ітераційні алгоритми для апроксимації оптимальних політик керування досліджуваними процесами при накладенні на їхній розвиток різнопланових обмежень. Також доведено ряд граничних теорем для розподілу сумарних прибутків розглядуваних процесів, коли ймовірність їх обриву прямує до нуля. На основі проведених досліджень одержано ефективні алгоритми розв'язання відкритої на даний момент проблеми оптимальної структури капіталу компаній.

2. The dissertation is devoted to the stochastic optimization of corporate models, and solving the problem of optimal dynamic capital structure based on the offered models. One of the main problem of this research is finding optimal control and stopping rules for specific class of terminating Markov Decision Processes which very good describe the economic evolution of classic enterprises, based on inner factors of their activity. In this work we gained the sufficient conditions of existence and developed the iteration algorithms for optimal policies of examined Markov Decision Processes, under different restrictions of their evolution. Also were proved some theorems for margin distributions of geometric sums that described total profits of elaborated models. Based on the results of this research was supposed the cardinally new and very effective approach to solving the problem dynamic optimal capital structure.

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. Наконечний Олександр Миколайович

2. Nakonechny Alexandr Nikolayovich

Кваліфікація: д.ф.-м.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

VII. Відомості про офіційних опонентів та рецензентів

Офіційні опоненти

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Кнопов Павло Соломонович

2. Кнопов Павло Соломонович

Кваліфікація: д.ф.-м.н., 01.01.09

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. Заславський Володимир Анатолійович

2. Заславський Володимир Анатолійович

Кваліфікація: к.ф.-м.н., 01.01.09

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 Сергієнко Іван Васильович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Сергієнко Іван Васильович

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Т.А.