

Розробка методів підтримки прийняття рішень в економічних процесах на основі ідентифікації параметрів і прогнозування ризиків

Науковий керівник проекту — професор В. Д. Романенко.

Роботу присвячено створенню теоретичних основ і методів для підтримки прийняття рішень в економіко-фінансових процесах на основі ідентифікації динамічних параметрів процесів, прогнозування і технологічного передбачення фінансових ризиків, сценарних методів передбачення екстремальних збурень, комплексування прогнозів, отриманих різними методами прогнозування, і на основі побудови дерева рішень стосовно відповідних ознак, що дозволяє знайти найбільш адекватний метод прогнозування. В проекті також буде створена методологія прогнозування змінної дисперсії вихідних координат гетероскедастичних процесів при різнотемповій дискретизації координат, що надасть можливість прогнозувати дисперсію на великий період дискретизації, який дорівнює декільком базовим періодам дискретизації.

У результаті використання проекту буде створено інформаційне програмне забезпечення системи підтримки прийняття рішень для ідентифікації параметрів математичних моделей економічних процесів, прогнозування і технологічного передбачення фінансових ризиків. Програмний комплекс по прогнозуванню фінансових ризиків буде використовуватись в управліннях прогнозування ризиків банків Надра, Укресімбанк, Укрсоцбанк, Форум та ін.

Теоретичні розробки по темі будуть використані в створенні інструментарію прийняття рішень при розробці проектів інвестування капіталу, при стратегічному і оперативному управлінні пасивами та активами банківської системи.