



**Vilniaus
universitetas**

Veiklos ataskaita

Ilja Jurčenko

Vilnius, 2026 m. kovo 31 d.

Tema: Dinaminis aktyvų paskirstymas mišriuose investiciniuose portfeliuose kintančių ekonominių ir politinių rizikų aplinkoje

Darbo vadovas: Prof. Dr. Igoris Belovas

Doktorantūros studijų laikotarpis: 2025 m. – 2029 m.

Studijų metai: 0.5

Doktorantūros studijų planas (I)

Studijų metai	Egzaminai	
	Planas	Įvykdyta
I / 1p (2025/2026)	1	1
I / 2p (2025/2026)	1	
II (2026/2027)	1	
III (2027/2028)	1	
IV (2028/2029)		
Iš viso:	4	1

Doktorantūros studijų planas (II)

Studijų metai	Dalyvavimas konferencijose				Publikacijos					
	Tarptautinėse		Nacionalinėse		Su citav. rodikliu			Be citav. rodiklio		
	Planas	Įvykdyta	Planas	Įvykdyta	Planas	Įvykdyta	Būklė	Planas	Įvykdyta	Būklė
I (2025/2026)										
II (2026/2027)	1									
III (2027/2028)										
IV (2028/2029)	1				2					
Iš viso:	2				2					

Ataskaitinio pusmečio planas

Egzaminai 2025/2026 (I pusmetis)		
Planas	Ivykdyta	Būklė
Skaitinis intelektas investuojant į vertybinius popierius, 2025 rudens semestras	Skaitinis intelektas investuojant į vertybinius popierius, 2025 rudens semestras	Išlaikyta, 10

Dalyvavimas konferencijose 2025/2026 (I pusmetis)		
Planas	Ivykdyta	Konferencijos tipas

Publikacijos 2025/2026 (I pusmetis)			
Planas	Ivykdyta	Būklė	Publikacijos tipas

Tarptautiniai renginiai ir publikacijos

Dalyvavimas tarptautinėse konferencijose	
	Aprašas
	Priimta santrauką į konferenciją: The 24th Conference of the International Federation of Operational Research Societies, Vienna, 2026.07.12-17 Pranešimo tema: A regime-switching HMM-Reinforcement Learning Framework for Dynamic Portfolio Allocation

Publikacijos (tik su citavimo rodikliu)		
	Bibliografinis aprašas	Būklė

Bendruosius gebėjimus stiprinančios veiklos

Dalyko pavadinimas	Data	Pro-gramos trukmė, val.	Pro-gramos apimtis kreditais ECTS	Trumpas turinio aprašymas
Mokslinės informacijos paieška: duomenų bazės ir DI įrankiai	2025 lapkričio mėn 7 d.	2,25 val	0.2	Paskaitos metu buvo pristatytos skirtingos mokslinės informacijos paieškos strategijos.
Informacijos saugojimas ir citavimas naudojantis programa Zotero	2025 lapkričio mėn 25 d.	2	0.15	Programos Zotero, skirtos tvarkyti šaltinius, programos pristatymas.
AIDA platformoje išlaikytas kursas „NVIDIA Application of AI for Anomaly Detection“	2025 lapkričio mėn. 22 d.	8	0.3	Train and evaluate models using XG-Boost, autoencoders, and GANs.
Įvadas į mokslo metriją	2025 lapkričio mėn 13	1,5 val	0.15	Paskaitoje buvo supažindinama su mokslo metrijos samprata ir ištakomis.
Pedagoginė veikla	2025 rugsėjo mėn – dabar		1	Rudens semestre dėsčiau finansų inžinerijos pratybas informatikos, fizikos bakalauro studentams.

Disertacijos rengimo etapai

Darbo pavadinimas		Atlikimo terminai	Pastabos
1.	Mokslinių tyrimų disertacijos tema apžvalga ir analizė (Lietuvoje ir užsienyje): 1.1. Analitinės apžvalgos atlikimas. 1.2 Disertacijos tyrimo objekto detalizavimas.	2025 spalio mėn. – 2026 rugsėjo mėn.	Atlikta literatūros apžvalga Atrinkta ir aprašyta aktuali literatūra Detalizuotas tyrimo objektas.

Tyrimo objektas ir tikslas

Tyrimo objektas. Automatizuota dinaminio investicinio portfelio valdymo strategija, paremta technine analize ir mašininiu mokymusi, pritaikyta kintantiems ekonominiams ciklams.

Tyrimo tikslas. Pasiūlyti investicinio portfelio grąžos ir rizikos valdymo patobulinimus, taikant techninės analizės metodų ir mašininio mokymo algoritmų kombinacijas kintančių ekonominių ciklų sąlygomis.

Tyrimo uždaviniai

1. Išanalizuoti investicinio portfelio gražos ir rizikos valdymo teorinius principus bei esamus portfelio formavimo metodus.
2. Ištirti techninės analizės ir mašininio mokymo metodų taikymo galimybes portfelio formavimui.
3. Patobulinti dinaminį investicinio portfelio valdymo modelį, integruojant techninės analizės rodiklius ir mašininio mokymo metodus.
4. Įvertinti sukurto modelio efektyvumą, palyginant jo rezultatus su tradiciniais portfelio valdymo metodais.

Ataskaitinio pusmečio rezultatai

Atlikta literatūros analizė portfelio valdymo ir techninės analizės tematika. Surinkta ir išanalizuota literatūra bus panaudota rengiant būsimas publikacijas bei disertacijos tekstą. Literatūros apžvalga bus tęsiama ir toliau, ją nuolat papildant naujausiais šios srities tyrimais ir moksliniais atradimais. Taip pat, buvo suformuluotas tyrimo objektas ir tikslas.

Be mokslinių pasiekimų, buvo išlaikytas egzaminas. Taigi, šio pusmečio planas buvo pilnai įvykdytas.

Kito pusmečio planas

1. Analitinės apžvalgos užbaigimas.
2. Tyrimo metodikos parinkimas ir preliminarus jos pritaikomumo išsikeltiems uždaviniams spręsti įvertinimas.
3. Empirinių tyrimų planavimas, remiantis pasirinkta tyrimo metodika.
4. Tarpinių tyrimų rezultatų pristatymas tarptautinėje konferencijoje.

Ačiū už dėmesį!