Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0410U001047

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 14-01-2010

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Лундгрен Марина Олександрівна
2. Lundgren Maryna Oleksandrivna

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: 21-12-2009

Спеціальність за освітою: 8.080102

Місце роботи здобувача: ЗАТ "Страхова компанія СЕБ Лайф Юкрейн"

Код за ЄДРПОУ: 34300653

Місцезнаходження: 01004 Київ, вул. Червоноармійська 10, корп. 1, к. 208

Форма власності:

Сфера управління:

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. Математичне дослідження страхового ринку з фінансовими інвестиціями

2. Mathematical investigation of insurance market with financial investments

Реферат/анотація:

1. Дисертаційну роботу присвячено процесам ризику, що містять інвестиції до одного або скінченної кількості ризикових активів та безризикового активу, а також змінну інтенсивність надходження страхових премій. Знайдено умови, за яких такі рівняння ризику мають розв'язки, та умови, за яких відповідні їм експоненціальні процеси є супермартингалами. Знайдено експоненціальні оцінки ймовірності банкрутства для таких процесів ризику. Застосовано новий підхід зведення задачі з інвестиціями до задачі без інвестицій для знаходження оцінки ймовірності банкрутства в моделі з інвестуванням усього капіталу до одного виду ризикових активів. Доведено існування розв'язку задачі оптимального інвестування для мінімізації ймовірності банкрутства страхової компанії у моделі ризику з інвестиціями у ризиковий та безризиковий активи та змінною інтенсивністю надходження страхових премій.

2. The thesis is devoted to the investigation of risk processes which contain investments into risky and non-risky assets and variable premium intensity function. In the first chapter we make a short review of literature connected with the topics studied in the thesis. In the second chapter basic definitions and statements which are used in subsequent chapters are collected. The third chapter is dedicated to the risk model with investment of all capital into one type of risky assets and variable premium intensity function. We give sufficient conditions for existence of a strong solution of the risk process, and also sufficient conditions for the exponential process to be supermartingale. We find an exponential ruin probability estimate in the case of quadratic premium intensity function. For the model with stopping investments at the moment when price of risky asset falls below a fixed level ruin probability estimate was found in the case of locally Lipschitz continuous premium intensity function. The forth chapter deals with the risk model with investments into one type of risky assets and non-risky assets, and also variable premium intensity function. Sufficient conditions for an existence of a strong solution of the risk process are given. Exponential process is proved to be supermartingale under certain conditions, and exponential ruin probability estimate is found for an linearly growing intensity function. The obtained estimate improves estimates known for models without investments, and for models with investments but with constant premium intensity. It is proved that the problem of minimizing the ruin probability with the choice of a suitable investment strategy has a solution. The optimal strategy is calculated using Hamilton-Jacobi-Bellman equation. In the fifth chapter the risk model with variable premium intensity function and investments into finite number of risky assets and one non-risky asset is considered. Using supermartingale technique, an exponential ruin probability estimate in the case of Lipschitz continuous premium intensity function and constant investments into risky assets is found.

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. Пилипенко Андрій Юрійович
2. Пилипенко Андрій Юрійович

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. Радченко Вадим Миколайович
2. Радченко Вадим Миколайович

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

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.