Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0413U004267

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 20-06-2013

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Іллічевський Сергій Олексійович
2. Illichevskuj Sergiy Oleksiyovych

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: так

Шифр наукової спеціальності: 08.00.11

Назва наукової спеціальності: Математичні методи, моделі та інформаційні технології в економіці

Галузь / галузі знань: Не застосовується

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 24-05-2013

Спеціальність за освітою: № 06БФ040-01

Місце роботи здобувача: ПАТ "САН ІнБев Україна"

Код за ЄДРПОУ: 30963655

Місцезнаходження: 03680, м.Київ, вул. Фізкультури, 30-В

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д 26.001.13

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: 06.35.51

Тема дисертації:

1. Моделювання ризику неплатоспроможності страхової компанії.

2. Modeling the Insolvency Risk of Insurance Company.

Реферат/анотація:

1. У дисертації розглянуто передумови, історію розвитку, сучасний стан, суперечності та перспективи розвитку українського ринку страхових послуг, проаналізовано існуючі економіко-математичні методи моделювання і прогнозування ризику неплатоспроможності страхової компанії, запропоновано нові моделі на основі штучних нейронних мереж, байєсівських мереж та порівняно з результатами існуючих моделей двостороннього оцінювання на напівмарківського процесу. Запропоновано нову комплексну модель оцінки ризику неплатоспроможності страхової компанії на основі байєсівських мереж, що включає в себе такі групи факторів, як макроекономічні показники, на які можуть впливати можлива друга хвиля європейської та світової фінансово-економічної кризи в 2013-2015 роках; законодавчі вимоги щодо регулювання учасників українського ринків страхових послу; фінансові показники компанії; управлінські рішення компанії. Створено інтегральну модель оцінки ризику неплатоспроможності страхової компанії на основі чотирьох:

модель на основі байєсівської мережі, двостороння модель А.Г. Гуреєва, двостороння модель В.В. Калашникова та модель на основі напівмарківського процесу. Використовуючи дану інтегральну модель оцінки ризику неплатоспроможності страхової компанії, було побудовано прогноз оцінки ризику неплатоспроможності для 20 страхових компаній України, що були обрані методом стратифікованого випадкового відбору.

2. The dissertation investigates the background, history, development, current status, controversies and prospects of development of the Ukrainian insurance market; analyzes existing economic and mathematical methods for modeling and predicting the risk of insolvency of the insurance company; offers new models based on artificial neural networks, Bayesian networks, and compared with the existing two-sided bounds for ruin probabilities models and for semi-Markov process. A new model of insolvency risk of the insurance company was built based on Bayesian networks, which includes such factors as macroeconomic indicators that may affect possible second wave of European and world financial-economic crisis in 2013-2015; legislative requirements for restrictions participants, financial indicators and management solutions for company. A model of integrated insolvency risk of the insurance company was built based on four models: a model based on Bayesian network model, two-sided bounds model of A.G. Gureev, two-sided bounds model V.V. Kalashnikov and model-based semi-Markov process. Using this integrated model of insolvency risk of the insurance company was built a forecast was built for 20 insurance companies in Ukraine, which were selected by stratified random sampling.

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. Ляшенко Олена Ігорівна

2. Ljashenko Olena Igorivna

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.11

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. Матвійчук Андрій Вікторович

2. Матвійчук Андрій Вікторович

Кваліфікація: д.е.н., 08.03.02

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. Кічкіна Тетяна Олексіївна

2. Кічкіна Тетяна Олексіївна

Кваліфікація: к.е.н., 08.00.11

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