Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0417U001669

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 14-04-2017

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Дубініна Світлана Віталіївна
2. Dubinina Svitlana Vitalyivna

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: так

Шифр наукової спеціальності: 05.13.23

Назва наукової спеціальності: Системи та засоби штучного інтелекту

Галузь / галузі знань: Не застосовується

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 04-04-2017

Спеціальність за освітою: 8.04030101

Місце роботи здобувача:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д 26.002.03

Повне найменування юридичної особи: Навчально-науковий комплекс "Інститут прикладного системного аналізу" Національного технічного університету України "Київський політехнічний інститут імені Ігоря Сікорського"

Код за ЄДРПОУ: 25408067

Місцезнаходження: проспект Перемоги, 37 , корпус 35, м. Київ, Київська обл., 03056, 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: Національний технічний університет України "Київський політехнічний інститут імені Ігоря Сікорського"

Код за ЄДРПОУ: 02070921

Місцезнаходження: 03056, м.Київ, пр.Перемоги, 37

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 28.23.02

Тема дисертації:

1. Байєсівські методи моделювання актуарних процесів та оцінювання ризиків страхових компаній

2. Bayesian methods of simulating actuarial processes and risk estimation of insurance company

Реферат/анотація:

1. Дослідження спрямоване на прогнозування величини страхових виплат у разі настання страхового випадку та оцінювання операційного ризику страхових компаній. Моделі розроблено у формі узагальнених лінійних моделей (УЛМ) та мережі Байєса, що є елементом новизни дослідження. Запропоновано процедуру адаптації виродженої статистичної вибірки з метою подальшої побудови УЛМ. Побудовано нові узагальнені лінійні моделі для обраних актуарних процесів, які забезпечують оцінювання короткострокових прогнозів стосовно страхових виплат прийнятної точності. Встановлено, що кращою є модель з гамма розподілом та логарифмічною функцією зв'язку. Також, для ймовірнісного оцінювання операційних ризиків страхових компаній розроблено мережу Байєса. Комплексна модель дає можливість вчасно запобігти банкротства СК і якісно проаналізувати необхідну величину страхових виплат при настанні страхового випадку за договорами

страхування.

2. The research is directed towards forecasting of insurance payments in respective cases and estimation of operational risk for insurance companies. The necessary mathematical models were developed in the form of generalized linear models (GLM) and Bayesian networks what is a new scientific element of the research. An adaptation procedure based on extreme value theory was proposed for processing degenerated statistical samples for constructing GLM. New generalized linear models were constructed for the selected actuarial processes that provide for a possibility of estimating high quality short term forecasts regarding insurance payments. It was established that the best model was the one with gamma distribution and logarithmic link function. To get the possibility for probabilistic estimation of operational risks the model in the form of Bayesian network was developed using a set of selected variables. The complex model developed provides a possibility for timely prevention of insurance company bankruptcy and perform an analysis for necessary volume of insurance payments according to the specific insurance policies. All computational experiments were performed with the decision support system designed and implemented by the author. The system constitutes a handy data analysis instrument for insurance company managers and can be easily extended with new functions.

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. Бідюк Петро Іванович
2. Bidyuk Petro Ivanovych

Кваліфікація: д.т.н., 05.13.03

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. Корабльов Микола Михайлович
2. Корабльов Микола Михайлович

Кваліфікація: д.т.н., 05.13.23

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. Пономаренко Сергій Олексійович
2. Пономаренко Сергій Олексійович

Кваліфікація: к.т.н., 20.02.14

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 Романенко Віктор Демидович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні

Романенко Віктор Демидович

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Т.А.