

Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0515U000884

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 20-11-2015

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:



II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Норкін Богдан Володимирович

2. Norkin Bogdan Vladimirovich

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: доктор наук

Аспірантура/Докторантура: ні

Шифр наукової спеціальності: 01.05.01

Назва наукової спеціальності: Теоретичні основи інформатики та кібернетики

Галузь / галузі знань: Не застосовується

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 30-10-2015

Спеціальність за освітою: 7.080101

Місце роботи здобувача: Інститут кібернетики ім. В.М. Глушкова

Код за ЄДРПОУ: 05417176

Місцезнаходження: 03680, м.Київ, МСП, пр. Ак. Глушкова, 40

Форма власності:

Сфера управління: Національна академія наук України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

III. Відомості про організацію, де відбувся захист

Шифр спеціалізованої вченої ради (разової спеціалізованої вченої ради): Д 26.194.02

Повне найменування юридичної особи: Інститут кібернетики імені В.М. Глушкова Національної академії наук України

Код за ЄДРПОУ: 05417176

Місцезнаходження: проспект Академіка Глушкова, 40, м. Київ, Київська обл., 03187, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Національна академія наук України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

IV. Відомості про підприємство, установу, організацію, в якій було виконано дисертацію

Повне найменування юридичної особи: Інститут кібернетики ім. В.М. Глушкова

Код за ЄДРПОУ: 05417176

Місцезнаходження: 03680, м. Київ, МСП, пр. Ак. Глушкова, 40

Форма власності:

Сфера управління: Національна академія наук України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 28.17.19

Тема дисертації:

1. Числові методи розв'язання стохастичних задач оптимізації у страховій математиці.
2. Numerical methods for solving stochastic optimization problems in insurance mathematics.

Реферат:

1. Дисертаційна робота присвячена розробці числових методів актуарної математики, а саме, числовому розв'язанню багатокритерійних стохастичних оптимізаційних задач і задач оцінки ризиків у страхуванні. Моделями страхової діяльності є керовані стохастичні процеси ризику, що моделюють стохастичну еволюцію капіталу і резервів страхової компанії. Як критерії прибутковості використовуються очікувані дисконтовані дивіденди, очікуваний дисконтований капітал у кінці планового періоду, дисперсії і квантилі цих величин та ін. Як показники ризику використовуються ймовірність розорення, очікуваний час життя процесу ризику, необхідний для запобігання розорення позиковий капі-тал, величина заборгованості в момент розорення та ін. У роботі розроблені числові методи розв'язання наступних задач: (а) розв'язання інтегральних рівнянь страхової математики, які задовольняє ймовірність розорення компанії як функція початкового капіталу; (б) розв'язання багатокритерійних задач стохастичного програмування, що виникають у страхових застосуваннях; (в) розв'язання багатокритерійних задач стохастичного оптимального керування

процесами ризику. Головним практичним результатом роботи є розробка паралельної інформаційної технології та програмних засобів вирішення багатокритерійних задач оптимізації та оцінки ризиків у страхуванні.

2. The thesis is devoted to the development of numerical methods of actuarial mathematics, namely, numerical methods for solution of stochastic multiobjective optimization problems and for risk assessment in insurance. As insurance business models the controlled stochastic risk processes are used, which model stochastic evolution of capital and reserves of an insurance company. As yield criteria expected discounted dividends, the expected discounted capital at the end of the planning period, dispersion and quantiles of these values and others are used. As the risk indicators ruin probability, the expected lifetime of the risk process, borrowed capital necessary to prevent the ruin, the amount of the debt at the time of ruin, and others are employed. In this paper we developed numerical methods for solving the following tasks: (a) the solution of integral equations of insurance mathematics, which specify the ruin probability as a function of the initial capital; (b) the solution of multiobjective stochastic programming problems, arising in insurance applications; (c) solution of multicriteria stochastic optimal control problems for optimal governing a risk process. The main practical result of the thesis is development of a parallel information technology and software for solution of multiobjective stochastic optimization problems and risk assessment in insurance.

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 ОПВ:

Впровадження результатів дисертації:

Зв'язок з науковими темами:

VI. Відомості про наукового керівника/керівників (консультанта)

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Сергієнко Іван Васильович
2. Sergienko Ivan Vasil'evich

Кваліфікація: д.ф.-м.н., 01.05.01

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. Лебедев Євген Олександрович

2. Лебедев Євген Олександрович

Кваліфікація: д.ф.-м.н., 01.05.04

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. Глибовець Микола Миколайович

2. Глибовець Микола Миколайович

Кваліфікація: д.ф.-м.н., 01.01.03

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. Касьянов Павло Олегович

2. Касьянов Павло Олегович

Кваліфікація: д.ф.-м.н., 01.01.01

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**

Сергієнко Іван Васильович

**Власне Прізвище Ім'я По-батькові
головуючого на засіданні**

Сергієнко Іван Васильович

**Відповідальний за підготовку
облікових документів**

Реєстратор

**Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є
відповідальним за реєстрацію наукової
діяльності**



Юрченко Т.А.