Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0412U003780

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 21-06-2012

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Шпирко Віктор Васильович
2. Shpyrko Victor Vasilievich

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: 18-05-2012

Спеціальність за освітою: 8.03050201

Місце роботи здобувача: 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

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. Методи та моделі оцінювання банкрутства страхових компаній.

2. Methods and Models of Ruin Evaluation of Insurance Companies.

Реферат/анотація:

1. У дисертації розроблено економіко-математичні моделі оцінювання ризиків страхових компаній, проаналізовано сучасний стан страхового ринку України, визначено ймовірності банкрутства для основних вітчизняних страхових компаній. Розкрито теоретико-методологічні засади закономірностей діяльності страхових компаній з точки зору класичної моделі ризику, які відображають специфіку даних об'єктів в умовах страхового ринку України. Здійснено оцінку ступеня надійності страхових компаній України на основі класичної моделі ризику та її розвинень, а також визначено міру ризику діяльності цих компаній як рівень ймовірності банкрутства. Було удосконалено способи моделювання і оцінки ризиків страхових компаній на основі класичних моделей, що дозволило більш широко застосувати класичну модель ризику до страхового ринку, зокрема показано можливість застосування точної формули для розрахунку ймовірності банкрутства страхової компанії у випадку, коли її виплати мають експоненціальний розподіл. Також

показано алгоритм застосування наближених оцінок ймовірності банкрутства страхових компаній, що дало можливість отримати чисельні апроксимації ймовірностей банкрутства. Наведено шість наближених формул та показано можливість їх застосування у випадку різних функцій розподілу страхових виплат. Також у роботі було розвинуто класичну модель ризику у випадку діяльності компанії у марковському середовищі та у випадку змінної страхової надбавки.

2. It has level of reliability evaluation for Ukrainian insurance companies based on classical risk model and its variations as well as defined risk measure of these companies as level of ruin probability. Ways of modeling and evaluation of insurance companies' risks were improved to let usage of classic model widely for insurance markets. As a snapshot possibility of using exact formula for ruin probability calculation when payments have exponential distribution was shown. Also usage possibility of approximate evaluations of insurance companies ruin to get numerical approximation of ruin probability in case when distribution function of insurance payments is not exponential type is shown. 6 approximate formulas can be found in this work to show their applicability in case of different insurance payment distribution functions. As there result different approaches to comparative analysis of classical risk model application are developed. As a case exact and approximate methods for insurance measure risk comparison were obtained. Also classic model was developed for the case when company is working in Markov's environment and for the case of variable insurance premium.

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. Черняк Олександр Іванович

2. Chernyak Oleksandr Ivanovych

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., 08.00.11

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Додаткова інформація:

Повне найменування юридичної особи:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Козьменко Ольга Володимирівна
2. Козьменко Ольга Володимирівна

Кваліфікація: д.е.н., 08.00.08

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.