Облікова картка дисертації

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0405U001217

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 31-03-2005

Статус: Захищена

Реквізити наказу МОН / наказу закладу:

II. Відомості про здобувача

Власне Прізвище Ім'я По-батькові:

1. Горобець Олександр Вікторович
2. Horobets Alexander Viktorovich

Кваліфікація:

Ідентифікатор ORCID ID: Не застосовується

Вид дисертації: кандидат наук

Аспірантура/Докторантура: так

Шифр наукової спеціальності: 01.05.04

Назва наукової спеціальності: Системний аналіз і теорія оптимальних рішень

Галузь / галузі знань: Не застосовується

Освітньо-наукова програма зі спеціальності: Не застосовується

Дата захисту: 13-03-2005

Спеціальність за освітою: 7.080101

Місце роботи здобувача: Львівський національний університет імені Івана Франка

Код за ЄДРПОУ: 02070987

Місцезнаходження: 79000, м. Львів, вул. Університетська, 1

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 26.001.35.

Повне найменування юридичної особи:

Код за ЄДРПОУ:

Місцезнаходження:

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

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

Повне найменування юридичної особи: Львівський національний університет імені Івана Франка

Код за ЄДРПОУ: 02070987

Місцезнаходження: 79000, м. Львів, вул. Університетська, 1

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

V. Відомості про дисертацію

Мова дисертації:

Коди тематичних рубрик: 28.29.03

Тема дисертації:

1. Прийняття рішень в моделях перестрахування страхових компаній

2. Decisions making in the reinsurance models of the insurers

Реферат/анотація:

1. Дисертація присвячена побудові і дослідженню економіко-математичних моделей оптимального управління діяльністю страхової компанії при перестрахуванні. Узагальнено класичну модель перестрахування страхових компаній з використанням функцій корисності на випадок будь-якої кількості перестраховиків та доведено критерій ефективності рішення. Досліджено моделі функціонування страхових компаній у нестабільній економіці, де нестабільність описується напівмарковським процесом. Розроблені моделі поведінки коефіцієнта Крамера-Лундберга при перестрахуванні. Доведені теореми, що показують, як змінюється асимптотична поведінка ймовірності банкрутства в залежності від тарифу перестрахування. Отримані результати впроваджені у діяльності компаній «Скайд-Вест» і «Скарбниця».

2. Thesis is dedicated to the construction and the investigation of the mathematical reinsurance models of optimal management of the insurer. The classical reinsurance model using functions of utility is generalized in the case of any quantity of companies and the criterion of effectiveness of the solutions is proven. The activity of insurance companies in the unstable economy is investigated, where the instability is described by semimarkovian process.

The models of the behavior of the Cramer-Lundberg coefficient under the reinsurance are developed. Theorems, which show the changes of the asymptotic behavior of the ruin probability in the dependence on the reinsurance rate, are proven. The obtained results are used in the work of the insurance companies "Skaid-West" and "Skarbnitsa".

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. Єлейко Ярослав Іванович
2. Yeleyko Yaroslav Ivanovich

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. Зінченко Надія Мусіївна
2. Зінченко Надія Мусіївна

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. Навродський Володимир Олександрович
2. Навродський Володимир Олександрович

Кваліфікація: к.ф.-м.н., 05.13.02

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 Наконечний Олександр Григорович

Власне Прізвище Ім'я По-батькові головуючого на засіданні Наконечний Олександр Григорович

Відповідальний за підготовку облікових документів

Реєстратор

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Т.А.