

## ОТЗЫВ

на автореферат диссертации Бублик Я.С. «Асимптотический анализ моделей страхования при дважды стохастических потоках страховых премий и выплат», представленной на соискание ученой степени кандидата физико-математических наук по специальности 05.13.18 – математическое моделирование, численные методы и комплексы программ

Математические модели различных экономических систем, в том числе и актуарных, в настоящее время вызывают большой интерес. Нужно отметить, что существуют достаточно много различных моделей, описывающих функционирование страховых компаний и подобных им. Но на сегодняшний день нет общепринятой математической модели.

Для исследования Бублик Я.С. выбрала варианты математических моделей: а) страхования с дважды стохастическими потоками премий и выплат, которые позволяют оценить вероятность разорения страховой компании и другие характеристики при произвольных распределениях премий и выплат, и б) модели некоммерческих фондов, цель деятельности которых похожа на цель деятельности страховых компаний.

В рамках выбранной модели а) в случае малой нагрузки страховых премий найдена вероятность разорения страховой компании на бесконечном временном интервале и производящая функция времени до разорения; доказано, что оно является асимптотически нормальным при неограниченно возрастающем начальном капитале. В случае модели б) получены выражения для плотностей распределения капитала фонда, продолжительностей периода неплатежеспособности и периода повышенных выплат.

Работа Я.С. Бублик представляет как теоретический, так и практический интерес. Основные результаты работы опубликованы в журналах Томских университетов, а докладывались только на Всероссийских научных конференциях. Исследования Я.С. Бублик являются определенным научным вкладом в теорию построения математических моделей функционирования страховых компаний и удовлетворяют требованиям к кандидатским диссертациям. Считаю, что автор диссертационной работы заслуживает присуждения ей ученой степени кандидата физико-математических наук.

Зав. кафедрой стохастического анализа  
и эконометрического моделирования  
Гродненского государственного университета  
имени Янки Купалы,  
доктор физико-математических наук, профессор

 М.А. Маталыцкий

Подпись профессора Маталыцкого М.А.  
удостоверяю, проректор ГрГУ им. Я. Купалы  
по научной работе, доктор технических наук,  
профессор

В.Г. Барсуков

17.02.2014 г.

Маталыцкий Михаил Алексеевич

Гродненский государственный университет имени Янки Купалы  
Республика Беларусь, г. Гродно, 230023, ул. Ожешко, 22  
Телефон: +375 (152) 73-19-00, факс: +375 (152) 73-19-10  
[mail@grsu.by](mailto:mail@grsu.by)

