ОТЗЫВ

на автореферат диссертационной работы 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

Диссертационная работа Бублик Я.С. «Асимптотический анализ моделей страхования при дважды стохастических потоках страховых премий и выплат» посвящена построению и исследованию математических моделей страховых компаний и некоммерческих фондов.

Любая математическая модель деятельности страховой компании наряду с правилами начисления страховых премий должна включать в себя статистические модели потоков страховых премий и выплат. В научной литературе встречаются в основном работы, посвященные классической модели процесса страхования, которая благодаря своей простоте позволяет вычислить статистические характеристики рассматриваемой модели. Однако классическая модель не отражает многие реальные черты деятельности страховых компаний и существует ещё ряд задач, требующих дополнительного исследования.

В частности сравнительно мало изученными являются модели страхования, в которых интенсивности потоков страховых премий и выплат меняются со временем, однако в реальности они могут меняться, например, за счёт сезонных изменений. Адекватной моделью потоков страховых премий и страховых выплат при этом являются дважды стохастические пуассоновские потоки. Близким к математическим моделям страхования являются математические модели деятельности некоммерческих фондов, целью которых, также как и страховых компаний является сбор и перераспределение денежных средств. Потоки денежных поступлений и выплат также могут являться случайными. Построению и исследованию математических моделей некоммерческих фондов посвящены лишь отдельные работы.

Решению именно этих проблем и посвящена рассматриваемая диссертационная работа, направленная на создание новых методов, позволяющих эффективно исследовать математические модели страховых компаний и некоммерческих фондов. Таким образом, тему диссертационной работы Бублик Я.С. следует считать практически значимой и актуальной.

Основные результаты работы докладывались и обсуждались на различных Всероссийских конференциях. Также по результатам диссертации опубликовано 20 работ, из них 6 статей в журналах, входящих в перечень рецензируемых научных журналов и изданий. Также стоит отметить, что исследования по диссертации бублик Я.С. выполнялись при поддержке грантов РФФИ и АВЦП.

По автореферату можно сделать следующее замечание.

В четвертой главе представлены примеры расчета вероятностей разорения и имитационного моделирования только для математических моделей страховых компаний, хотелось бы увидеть такие результаты и для математических моделей некоммерческих фондов, исследованных в третьей главе диссертации.

Данное замечание не снижают научную ценность диссертационной работы. Представленная диссертация является законченной научно-исследовательской работой, выполненной на достаточно высоком математическом уровне, и отвечает требованиям, предъявляемым к кандидатским диссертациям, а ее автор, Бублик Я.С., заслуживает присуждения ей ученой степени кандидата физико-математических наук по специальности 05.13.18 – математическое моделирование, численные методы и комплексы программ.

Сведения о лице, предоставившем отзыв:
Медведев Геннадий Алексеевич.
Пр. Независимости 4, 220030, г. Минск, Беларусь. Тел. (375 17) 2095129
MedvedevGA@bsu.by
Белорусский государственный университет.
Профессор кафедры теории вероятностей и математической статистики.

Доктор физико-математических наук,
профессор

Г. А. Медведев

Подпись Медведева Г.А. удостоверяю
Ведущий специалист управления
организационной работы и документационного
обеспечения
25.02 20 14