

Сведения о ведущей организации и официальных оппонентах
на диссертацию Муромской Анастасии Андреевны
«Некоторые стохастические модели актуарной математики»
по специальности 01.01.05 «теория вероятностей и математическая
статистика»

Ведущая организация:

Федеральное государственное учреждение «Федеральный исследовательский центр «Информатика и управление» Российской академии наук» (ФИЦ ИУ РАН).

Директор: академик РАН Соколов Игорь Анатольевич.
119333, Россия, г. Москва, ул. Вавилова, д. 44, корп. 2.
Телефон +7 (499) 135-62-60.

Основные публикации:

1. Королев В.Ю., Черток А.В., Корчагин А.Ю., Горшенин А.К. Вероятностно-статистическое моделирование информационных потоков в сложных финансовых системах на основе высокочастотных данных // Информатика и ее применения, 2013. Т. 7. Вып. 1. С. 12-21.
2. Zeifman A., Satin Ya., Korolev V., Shorgin S. On truncations for weakly ergodic inhomogeneous birth and death processes // International Journal of Applied Mathematics and Computer Science, 2014. Vol. 24. No. 3. P. 503-518.
3. Gorshenin A.K. On Implementation of EM-type Algorithms in the Stochastic Models for a Matrix Computing on GPU // AIP Conference Proceedings, 2015. Vol. 1648. 250008. 4 p.
4. Королев В.Ю., Корчагин А.Ю., Соколов И.А. Обобщенные дисперсионные гамма-распределения как модели статистических закономерностей на финансовых рынках // Информатика и ее применения, 2015. Т. 9. Вып. 4. С. 14-28.
5. Korolev V., Chertok A., Korchagin A., Zeifman A. Modeling high-frequency order flow imbalance by functional limit theorems for two-sided risk processes // Applied Mathematics and Computation, 2015. Vol. 253. P. 224-241.
6. Zeifman A.I., Korolev V.Yu., Chertok A.V., Shorgin S.Ya. On ergodicity bounds for an inhomogeneous birth-death process // AIP Conference Proceedings, 2015. Vol. 1648. P. 250011-1-250011-4.
7. Zeifman A., Korotysheva A., Satin Y., Korolev V., Shorgin S., Razumchik R. Ergodicity and perturbation bounds for inhomogeneous birth and death processes with additional transitions from and to origin // International Journal of Applied Mathematics and Computer Science, 2015. Vol. 25. No. 4. P. 787-802.
8. Королев В.Ю., Арефьева Е.В., Нефедова Ю.С., Горшенин А.К., Лазовский Р.А. Метод оценивания вероятностей катастроф в

неоднородных потоках экстремальных событий и его применение к прогнозированию землетрясений в Арктике // Проблемы анализа риска, 2016. Т. 13. No. 4. С. 80-91.

9. Konovalov M., Razumchik R. Simulation and selection of efficient decision rules in bank's manual underwriting process // Proceedings of the 30th European Conference on Modelling and Simulation, ECMS 2016, Regensburg, Germany, May 31 – June 3, 2016. P. 651-657.

Официальный оппонент: Белопольская Яна Исаевна (e-mail: yana@yb1569.spb.edu), доктор физико-математических наук (специальность 01.01.05), профессор кафедры математики строительного факультета ФГБОУ ВО «Санкт-Петербургский государственный архитектурно-строительный университет».

190005, Россия, г. Санкт-Петербург, 2-я Красноармейская ул., д. 4.

Основные публикации:

1. Белопольская Я.И., Вероятностные модели динамики роста клеток при контактном ингибировании. Математические заметки. N 3 (2017), 346-358.
2. Белопольская Я.И., Стохастическая интерпретация квазилинейных параболических систем с кросс-диффузией. ТВиП. Т. 61, N 2 (2016), 268-299.
3. Belopolskaya Ya., Probabilistic representation of the Cauchy problem solutions for systems of nonlinear parabolic equations. Global and Stochastic Analysis. V. 3, N 1 (2016), 25-32.
4. Белопольская Я.И., Немченко Е.И., Вероятностные представления и численные алгоритмы построения классических и вязкостных решений задачи Коши для квазилинейных параболических систем. Записки научн. сем. ПОМИ. Т. 442 (2015), 18-47.
5. Белопольская Я.И., Вероятностное представление обобщенного решения задачи Коши для системы кросс-диффузии. ДАН России. Т. 461, N 1 (2015), 1-4.
6. Belopolskaya Ya., Markov processes associated with fully nondiagonal systems of parabolic equations. Markov processes and related fields. V. 20, N 3 (2014), 452-478.
7. Belopolskaya Ya., Probabilistic counterparts of nonlinear parabolic PDE systems. Modern Stochastics and Applications – Springer Optimization and Its Applications. V. 90 (2014), 71-94.
8. Belopolskaya Ya., Woyczynski W., SDEs, FBSDEs and fully nonlinear parabolic systems. Rendiconti del Seminario Matematico Torino. V. 71, N 2 (2013), 209-219.
9. Belopolskaya Ya., Woyczynski W., Generalized solution of the Cauchy problem for systems of nonlinear parabolic equations and diffusion processes. Stochastics and Dynamics. V. 11, N. 1 (2012), 1-31.

10. Belopolskaya Ya., Probabilistic approach to solution of nonlinear PDES arising in financial mathematics. J. Math. Sci. V. 167, N 4 (2010), 444-460.

Официальный оппонент: Громов Александр Николаевич (e-mail: gromovaleksandr@gmail.com), кандидат физико-математических наук (специальность 01.01.05), старший управляющий директор, начальник Управления публичного акционерного общества «Сбербанк России».

117997, Россия, г. Москва, ул. Вавилова, д. 19.

Основные публикации:

1. Громов А.Н. *Оптимальная стратегия перестрахования эксцедента убытка*, Вестник Московского Университета. Серия 1, Математика. Механика, 2011, в. 4, 17-22.
2. Громов А.Н. *Оптимальная стратегия перестрахования и инвестирования*, Вестник Московского Университета. Серия 1, Математика. Механика, 2013, в. 2, 6-12.
3. Громов А.Н. *Оптимальное инвестирование в модели с возможностью вливания капитала*, Сборник «Современные проблемы математики и механики», 2013, в. 3, 52-60.
4. Bulinskaya E., Gromov A. *Asymptotic behavior of the processes describing some insurance models*, Communications in Statistics - Theory and Methods, 2016, vol. 45, N 6, 1778-1793.

Ученый секретарь диссертационного совета
Д 501.001.85 на базе МГУ имени М.В. Ломоносова

доктор физико-математических наук, профессор

