

Сведения о ведущей организации и официальных оппонентах
на диссертацию Гусак Юлии Валерьевны
«Стохастические модели перестрахования и их оптимизация»
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)
119333, г. Москва, ул. Вавилова, 44, к.2.
Телефон: +74991356260.

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. Kononov 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: Рыков Владимир Васильевич

(e-mail: vladimir_rykov@mail.ru), доктор физико-математических наук (специальность 01.01.05), профессор, профессор кафедры прикладной математики и компьютерного моделирования ФГУБОУ ВО «Российский государственный университет нефти и газа (национальный исследовательский университет) имени И.М. Губкина».

119991, Россия, г. Москва, Ленинский пр-т., д. 65

Основные публикации:

1. Rykov V.V., Ngia T.A. On sensitivity of a system reliability characteristics to the shape of their elements life and repair time distributions // Vestnik PFUR Ser. Mathematics. Informatics. Physics, № 3. 2014. Pp. 65-77.
2. Rykov V.V. On Engineering Risks of Complex Hierarchical Systems Analysis. Statistical Models and Methods for Reliability and Survival Analysis. Wiley, Ltd., Hoboken. 2014. Pp. 391-405.
3. Rykov V.V. On a Slow Server Problem. Stochastic Orders in Reliability and Risk // Lecture Notes in Statistics, 208. Proceedings. Springer. 2013. Pp. 351- 361.
4. Rykov V.V., Efrosinin D.V. On optimal control of systems on their life time // Resent Advances in System Reliability. Springer Series in Reliability Engineering. Springer. 2012. Pp. 307-319.

Официальный оппонент: Румянцев Александр Сергеевич (e-mail: ar0@krc.karelia.ru), кандидат физико-математических наук (специальность 05.13.18), научный сотрудник лаборатории телекоммуникационных систем ФГБУН Институт прикладных математических исследований Карельского научного центра Российской академии наук.

185910, Россия, респ. Карелия, г. Петрозаводск, ул. Пушкинская, д. 11

Основные публикации:

1. Morozov E., Potakhina L., Rumyantsev A. Stability Analysis and Simulation of a State-Dependent Transmission Rate System // Man-Machine Interactions 4. Advances in Intelligent Systems and Computing, Vol. 391 : Springer International Publishing, 2016. Pp. 673-683.
2. Rumyantsev A., Morozov E. Accelerated Verification of Stability of Simultaneous Service Multiserver Systems // Proceedings of 2015 7th International Congress on Ultra Modern Telecommunications and Control Systems and Workshops (ICUMT). 2015. Pp. 239-242.
3. Rumyantsev A., Morozov E. Stability criterion of a multiserver model with simultaneous service // Ann Oper Res. 2015. DOI: 10.1007/s10479-015-1917-2
4. Rumyantsev A. Stabilization of a high performance cluster model // Proceedings of 2014 6th International Congress on Ultra Modern Telecommunications and Control Systems and Workshops (ICUMT). 2015. Pp. 518-521.
5. Румянцев А. С., Морозов Е. В. Распределения тяжелыми хвостами и их приложения : монография // Петрозаводск : Изд-во ПетрГУ. 2013. 68 с.

Ученый секретарь диссертационного совета
Д 501.001.85 на базе МГУ им. М.В. Ломоносова
доктор физико-математических наук, профессор



Власов
Виктор Валентинович