

## СВЕДЕНИЯ О НАУЧНОМ КОНСУЛЬТАНТЕ

по диссертационной работе Васильевой Софии Николаевны

на тему «Алгоритмы анализа и оптимизации квантильного критерия в задачах стохастического программирования с билинейными и квазилинейными функциями потерь»,  
представленной на соискание ученой степени кандидата физико-математических наук по специальностям 05.13.01 – «Системный анализ, управление и обработка информации (авиационная и ракетно-космическая техника)», 05.13.18 – «Математическое моделирование, численные методы и комплексы программ».

№	Фамилия, имя, отчество	Год рождения, гражданство	Место основной работы (название организации, ведомство, город, занимаемая должность)	Ученая степень (шифр специальности, по которой присуждена ученая степень в соответствии с действующей Номенклатурой специальностей научных работников)	Ученое звание
1	2	3	4	5	6
1	Кибзун Андрей Иванович	1951 г.р., РФ	Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Московский авиационный институт (национальный исследовательский университет)», Министерство науки и высшего образования РФ, Москва, заведующий кафедрой 804 «Теория вероятностей и компьютерное моделирование»	Доктор физико- математических наук, шифр специальности 01.01.11, диплом доктора наук ФМ № 003683 от 03.07.1987, протокол № 26д/2	Профессор, аттестат профессора ПР № 004503 от 22.02.1990, протокол № 63/п
Данные о научной деятельности по заявленной научной специальности за последние 5 лет:					
а) Перечень научных публикаций (без			1. <i>Kibzun A.I., Tarasov A.N.</i> Stochastic Model of the Electric Power Purchase System on		

дублирования, не более 15) в изданиях, индексируемых в международных цитатно-аналитических базах Web of Science и Scopus, а также в специализированных профессиональных базах данных Astrophysics, PubMed, Mathematics, Chemical Abstracts, Springer, Agris, GeoRef, MathSciNet, BioOne, Compendex и т.п.

- a Railway Segment // Automation and Remote Control. 2008. 79(3), pp. 425-438. **Scopus, WoS.**
2. *Kibzun A.I., Ignatov A.N.* On the existence of optimal strategies in the control problem for a stochastic discrete time system with respect to the probability criterion // Automation and Remote Control. 2017. 78(10), pp. 1845-1856. **Scopus, WoS.**
  3. *Kibzun A.I., Ivanov S.V.* Convergence of discrete approximations of stochastic programming problems with probabilistic criteria // Lecture Notes in Computer Science (including subseries Lecture Notes in Artificial Intelligence and Lecture Notes in Bioinformatics). 2016. 9869, pp. 525-537.
  4. *Kibzun A.I., Sobol' V.R.* The modified sequential hedging strategy: Hedger's loss distribution // Automation and Remote Control. 2015. 76(11), pp. 1931-1944. **Scopus, WoS.**
  5. *Kibzun A.I., Ignatov A.N.* The two-step problem of investment portfolio selection from two risk assets via the probability criterion // Automation and Remote Control. 2015. 76(7), pp. 1201-1220. **Scopus, WoS.**
  6. *Kibzun A.I., Khromova O.M.* On reduction of the multistage problem of stochastic programming with quantile criterion to the problem of mixed integer linear programming // Automation and Remote Control. 2014. 75(4), pp. 688-699. **Scopus, WoS.**
  7. *Kibzun A.I., Inozemtsev A.O.* Using the maximum likelihood method to estimate test complexity levels. Automation and Remote Control. 2014. 75(4), pp. 607-621. **Scopus, WoS.**
  8. *Kibzun A.I., Khromova O.M.* On reduction of the two-stage problem of quantile optimization to the problem of convex programming // Automation and Remote Control. 2014. 75(5), pp. 859-871. **Scopus, WoS.**
  9. *Norkin V.I., Kibzun A.I., Naumov A.V.* Reducing Two-Stage Probabilistic Optimization Problems with Discrete Distribution of Random Data to Mixed-Integer Programming Problems // Cybernetics and Systems Analysis. 2014. 50(5), pp. 679-692. **Scopus, WoS.**
  10. *Береснев В.Л., Кибзун А.И.* Некоторые современные проблемы математического

	<p>программирования // Автоматика и телемеханика, 2014. № 4, с. 3-4. <b>Scopus, WoS.</b></p> <p>11. Борисов А. В., Босов А. В., Кибзун А. И., Миллер Г. Б., Семенихин К. В. Метод условно-минимаксной нелинейной фильтрации и современные подходы к оцениванию состояний нелинейных стохастических систем // Автоматика и телемеханика, 2018, № 1, 3–17. <b>Scopus, WoS.</b></p> <p>12. Иванов С. В., Кибзун А. И. О сходимости выборочных аппроксимаций задач стохастического программирования с вероятностными критериями // Автоматика и телемеханика, 2018, № 2, 19–35. <b>Scopus, WoS.</b></p> <p>13. Кибзун А. И., Игнатов А. Н. О существовании оптимальных стратегий в задаче управления стохастической системой с дискретным временем по вероятностному критерию // Автоматика и телемеханика, 2017, № 10, 139–154. <b>Scopus, WoS.</b></p> <p>14. Кибзун А. И., Игнатов А. Н. Сведение двухшаговой задачи стохастического оптимального управления с билинейной моделью к задаче смешанного целочисленного линейного программирования // Автоматика и телемеханика, 2016, № 12, 89–111. <b>Scopus, WoS.</b></p>
<p>б) Перечень научных публикаций в журналах, входящих в Перечень РФ рецензируемых научных изданий, в которых должны быть опубликованы основные научные результаты диссертаций на соискание ученой степени кандидата наук, на соискание ученой степени доктора наук, с указанием импакт-фактора журнала на основании данных библиографической базы данных научных публикаций российских ученых Российский индекс научного цитирования (РИНЦ) (Указать выходные данные)</p>	<p>1. С.В. Иванов, А.И. Кибзун Выборочная аппроксимация двухэтапной задачи стохастического линейного программирования с квантильным критерием // Труды института математики и механики ИММ УрО РАН, 2017, т. 23, № 3, с. 134-143. Импакт-фактор РИНЦ 0,411.</p> <p>2. А.И. Кибзун, О.М. Хромова О коррекции положения стохастической системы по квантильному критерию // Труды МАИ, 2014, № 72, с. 1. Импакт-фактор РИНЦ 0,361.</p> <p>3. А. И. Кибзун, В. Р. Соболев Двухшаговая задача хеджирования европейского колл-опциона при случайной длительности транзакций // Труды института математики и механики ИММ УрО РАН, 21, № 3, 2015, 164–174 Импакт-фактор РИНЦ 0,411.</p>
<p>в) Общее число ссылок на публикации</p>	<p>834 (РИНЦ), 164 (Scopus), 50 (Web of Science)</p>

<p>г) Участие с приглашенными докладами на международных конференциях (указать тему доклада, дату и место проведения)</p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Kibzun AI, Ignatov AN. Measurability of Optimal Strategies in the Stochastic Optimal Control Problem with Discrete Time. Methods of Optimization and Their Applications – 17<sup>th</sup> Baikal International Triennial School-Seminar. Buryatia, 31<sup>th</sup> of July-6<sup>th</sup> of August, 2017.</li> <li>2. Кибзун АИ. Постановки задач стохастического программирования. Методы оптимизации и их Приложения – XVI Байкальская международная школа-семинар. Иркутск, 25-29 июня 2014.</li> </ol>
<p>д) Рецензируемые монографии по тематике, отвечающей заявленной научной специальности (выходные данные, тираж)</p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Кибзун А.И., Кан Ю.С. Задачи стохастического программирования с вероятностными критериями. – М.: ФИЗМАТЛИТ, 2009. - 372 с. - 500 экз. ISBN 978-5-9221-1148-5.</li> </ol>
<p>е) Препринты, размещенные в международных исследовательских сетях (электронный адрес размещения материалов)</p>	<p>нет</p>
<p>ж) патенты</p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Игнатов АН, Кибзун АИ, Платонов ЕН. Программно-аналитический комплекс расчета вероятности бокового столкновения пассажирского поезда с маневровым составом на станции. Свидетельство о регистрации программы для ЭВМ RUS 2017617690. 11.07.2017.</li> </ol>

Председатель диссертационного совета Д 212.125.04,  
д.ф.-м.н., доцент

Ученый секретарь диссертационного совета Д 212.125.04,  
к.ф.-м.н., доцент

А. В. Наумов

Н. С. Северина

