

СВЕДЕНИЯ О ВЕДУЩЕЙ ОРГАНИЗАЦИИ

по диссертационной работе Соболя Виталия Романовича
на тему: «Синтез оптимальных стратегий в задачах последовательного хеджирования колл-опционов при наличии полосы нечувствительности», представленной на соискание ученой степени кандидата физико-математических наук по специальности 05.13.01 – «Системный анализ, управление и обработка информации (авиационная и ракетно-космическая техника)»

Наименование организации: Федеральное государственное бюджетное учреждение науки Институт математики им. С. Л. Соболева Сибирского отделения Российской академии наук.

Год образования: 1957 г.

Основные направления научной деятельности:

- Алгебра, теория чисел и математическая логика;
- Геометрия и топология;
- Математический анализ, дифференциальные уравнения и математическая физика;
- Теория вероятностей и математическая статистика;
- Вычислительная математика;
- Дискретная математика, информатика и математическая кибернетика;
- Математическое моделирование и методы прикладной математики;
- Теоретическая физика элементарных частиц и атомного ядра.

Директор: Гончаров Сергей Савостьянович, член-корреспондент РАН

Адрес организации: 630090 Новосибирск, пр. Академика Коптюга, 4

Контактный телефон: (8-383) 333-28-92

Факс: (8-383) 333-25-98


Адрес электронной почты: im@math.nsc.ru

Веб-сайт: <http://math.nsc.ru>

Основные работы по профилю диссертации:

- 1) Плясунов А.В., Панин А.А. Задача ценообразования. Часть I. Точные и приближенные алгоритмы решения // Дискретный анализ и исследование операций. 2012. Том 19. № 5. С. 83–100.
- 2) Плясунов А.В., Панин А.А. Задача ценообразования. Часть 2: Вычислительная сложность // Дискретный анализ и исследование операций. 2012. Том 19. № 6. С. 56–71.
- 3) Пашенко Ю.А., Плясунов А.В., Панин А.А. Двухуровневые модели конкурентного размещения производства и ценообразования // Автоматика и телемеханика. 2014. № 4. С. 153–169.
- 4) Плясунов А.В., Панин А.А. О сложности двухуровневых задач размещения и ценообразования // Дискретный анализ и исследование операций. 2014. том 21. № 5. С. 54–66.
- 5) Кочетов Ю.А., Плясунов А.В., Панин А.А. Сравнение метаэвристик для решения двухуровневой задачи размещения предприятий и фабричного ценообразования // Дискретный анализ и исследование операций. 2015. Том 22. № 3. С. 36–54.

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


А. В. Наумов

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


Н. С. Северина