

Сведения о ведущей организации

по диссертации Гусева Сергея Анатольевича «Оценка математических ожиданий функционалов от диффузионных процессов и их производных по параметрам методом Монте-Карло», представленной на соискание ученой степени доктора физико-математических наук по специальности 01.01.07 – Вычислительная математика

Полное и сокращенное наименование организации	федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Московский авиационный институт (национальный исследовательский университет)», МАИ
Место нахождения	Российская Федерация, г. Москва
Почтовый адрес	Волоколамское шоссе, д. 4, г. Москва, А-80, ГСП-3, 125993
Телефон	+7 499 158-43-33, 158-58-70, 158-00-02
Адрес электронной почты	mai@mai.ru
Адрес официального сайта в сети интернет	www.mai.ru

Список основных публикаций работников ведущей организации по теме диссертации в рецензируемых научных изданиях за последние 5 лет (не более 15 публикаций)

№	Авторы публикации	Название публикации.	Наименование издания	Год публикации	Импакт-фактор издания (По данным базы данных «Сеть науки» (Web of Science))
1.	Kibzun, A.	Comparison of two algorithms for solving a two-stage bilinear stochastic programming problem with quantile criterion. DOI: 10.1002/asmb.2115 WOS:000368073800009	APPLIED STOCHASTIC MODELS IN BUSINESS AND INDUSTRY V. 31, No. 6, p. 862-874. ISSN: 1524-1904	2015	0.725
2.	Kibzun, A. I. Sobol', V. R.	The modified sequential hedging strategy: Hedger's loss distribution DOI:	AUTOMATION AND REMOTE CONTROL Том: 76 Выпуск:	2015	0.266

		10.1134/S00051179151100 3X WOS:000365177600003	11 Стр.: 1931-1944 ISSN: 0005-1179		
3	Kibzun, A. I.; Khromova, O. M.	On Reduction of the Two- Stage Problem of Quantile Optimization to the Problem of Convex Programming DOI: 10.1134/S00051179140500 51 WOS:000335955000005	AUTOMATION AND REMOTE CONTROL Том: 75 Выпуск: 5 Стр.: 859-871 ISSN: 0005-1179	2014	0.266
4	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 DOI: 10.1134/S00051179140400 92 WOS:000334423100009	AUTOMATION AND REMOTE CONTROL Том: 75 Выпуск: 4 Стр.: 688-699 ISSN: 0005-1179	2014	0.266
5	Ignatov, A. N.; Kibzun, A. I.	On formation of security portfolio with uniform distribution by logarithmic criterion and priority risk component DOI: 10.1134/S00051179140300 60 WOS:000332738300006	AUTOMATION AND REMOTE CONTROL Том: 75 Выпуск: 3 Стр.: 481-495 ISSN: 0005-1179	2014	0.266
6	Kibzun, A. I.; Naumov, A.	On Reducing a Quantile Optimization Problem with	AUTOMATION AND REMOTE	2013	0.266

	V. ; Norkin, V. I.	Discrete Distribution to a Mixed Integer Programming Problem DOI: 10.1134/S0005117913060064 WOS:000322257500006	CONTROL Том: 74 Выпуск: 6 Стр.: 951-967 ISSN: 0005-1179		
7	Kibzun, A. I.; Chernobrovov, A. I.	Stochastic quasigradient algorithm to minimize the function of integral quantile DOI: 10.1134/S000511791202004X WOS:000300280000004	AUTOMATION AND REMOTE CONTROL Том: 73 Выпуск: 2 Стр.: 247-264 ISSN: 0005-1179	2012	0.266
8	Kibzun, A. I.; Chernobrovov, A. I.	Algorithm to Solve the Generalized Markowitz Problem DOI: 10.1134/S0005117911020081 WOS:000287660400008	AUTOMATION AND REMOTE CONTROL Том: 72 Выпуск: 2 Стр.: 289-304 ISSN: 0005-1179	2011	0.266
9	Kibzun, A. I. Sobol', V. R.	The modified sequential hedging strategy: Hedger's loss distribution DOI: 10.1134/S000511791511003X WOS:000365177600003	AUTOMATION AND REMOTE CONTROL Том: 76 Выпуск: 11 Стр.: 1931-1944 ISSN: 0005-1179	2015	0.266
10	Kibzun, A. I.; Khromova, O. M.	On Reduction of the Two-Stage Problem of Quantile Optimization to the Problem of Convex Programming DOI: 10.1134/S00051179140500	AUTOMATION AND REMOTE CONTROL Том: 75 Выпуск: 5 Стр.: 859-871	2014	0.266

		51 WOS:000335955000005	ISSN: 0005-1179		
11	Naumov A.V., Ivanov S.V.	On stochastic linear programming problems with the quantile criterion DOI: 10.1134/S0005117911020123 WOS:000287660400012	AUTOMATION AND REMOTE CONTROL Том: 72 Выпуск: 2 Стр.: 353-369 ISSN: 0005-1179	2011	0.266
12	Naumov A.V., Ivanov S.V.	Algorithm to optimize the quantile criterion for the polyhedral loss function and discrete distribution of random parameters DOI: 10.1134/S0005117912010080 WOS:000298964000008	AUTOMATION AND REMOTE CONTROL ISSN: 0005-1179 Том: 73 Выпуск: 1 Стр.: 105-117	2012	0.266
13	Semenikhin, K. V.	Minimax linear filtering of random sequences with uncertain covariance function DOI: 10.1134/S0005117916020028 WOS:000370333000002	AUTOMATION AND REMOTE CONTROL Том: 77 Выпуск: 2 Стр.: 226-241 ISSN: 0005-1179	2016	0.266
14	Borisov, A. V. ; Miller, B. M.; Semenikhin, K. V.	Filtering of the Markov Jump Process Given the Observations of Multivariate Point Process DOI: 10.1134/S0005117915020034 WOS:000351233600003	AUTOMATION AND REMOTE CONTROL Том: 76 Выпуск: 2 Стр.: 219-240 ISSN: 0005-1179	2015	0.266

15	Pankov, A. R.; Platonov, E. N. ; Semenikhin, K. V.	Robust Filtering of Process in the Stationary Difference Stochastic System DOI: 10.1134/S00051179110201 47 WOS:000287660400014	AUTOMATION AND REMOTE CONTROL Том: 72 Выпуск: 2 Стр.: 377-392 ISSN: 0005-1179	2011	0.266
----	--	--	---	------	-------

И.о. ректора по научной работе

В.А. Шевцов

