

Резюме

- 1. Персональные данные** Белкина (Конюхова) Татьяна Андреевна, дата рождения - 19 мая 1966 г.
- 2. Контактные сведения** тел.: (916)545-79-43
e-mail: tbel@cemi.rssi.ru, t_bel@mail.ru
- 3. Высшее образование.** Московский институт электронного машиностроения (в настоящее время Московский институт электроники и математики НИУ ВШЭ), закончила с отличием в 1989 г. Специальность: прикладная математика
- 4. Ученые степени и звания**

1993 г. – кандидат физико-математических наук по специальности «Теория вероятностей и математическая статистика», диссертация «Об асимптотической оптимальности по вероятности и почти наверное в задачах линейного регулирования», выполнена и защищена в Московском институте электроники и математики.

2000 г. – звание доцента по кафедре математической экономики.

5. Опыт работы

Основная занятость

С 1995 г. по настоящее время – Центральный экономико-математический институт РАН – заведующий лабораторией теории риска с марта 2009 г. (с сентября 2016 г. в результате реорганизации подразделений лаборатория носит название лаборатории стохастической оптимизации и теории риска).

С 1993 г. по 1995 г. – Московский институт электроники и математики, с 1995 г. – на должности доцента.

С 1989 г. по 1993 г. – аспирантура Московского института электронного машиностроения.

Частичная занятость

Сентябрь 2014 г. - июль 2015 – Международная лаборатория количественных финансов НИУ ВШЭ – старший научный сотрудник

Октябрь 1995 г. - декабрь 2012 г. – Московский институт электроники и математики (с января 2012 МИЭМ НИУ ВШЭ) - доцент

Сентябрь 2005 г. - август 2009 г. – Высшая школа экономики, кафедра управления рисками и страхования - доцент

Сентябрь 2001 г. - октябрь 2003 г. – Российская экономическая школа – ассистент профессора

6. Краткосрочные позиции за рубежом

2013 г., 2-30 мая – Университет Бонна, Германия, Математический институт Хаусдорфа, Трimestровая программа «Стохастическая динамика в экономике и финансах» – associate professor

2008 г., июнь-июль – Университет Карлсруэ, Германия, Институт финансов, банковского дела и страхования – научный сотрудник

7. Курсы повышения квалификации.

Декабрь 1999- март 2000 гг. – курсы повышения квалификации Государственного университета гуманитарных наук по направлению «Экономика».

1997 г. - курсы подготовки преподавателей-мультипликаторов для обучения актуариев негосударственных пенсионных фондов, организованные Высшей школой экономики совместно с Фондом “Ню-Хау” (Великобритания).

1994 г. - Московская летняя школа экономики, организованная Лондонской школой экономики и политических наук совместно с МГУ.

8. Участие в программах грантов.

1996-2015 – участие в проектах РФФИ.

2014-2015 - грант Правительства РФ для поддержки научных исследований под руководством ведущих ученых, договор 14.А12.31.0007

2004-2005 – грант Фонда содействия отечественной науке по программе «Лучшие экономисты РАН (кандидаты наук)»

2001-2003 – руководство проектом, поддержанным грантом РАН по результатам 6-го конкурса-экспертизы проектов молодых ученых по фундаментальным и прикладным исследованиям

1999-2001 – участие в проекте INTAS

1997-1999 - Государственная научная стипендия для молодых ученых

1994-1995 – участие в проекте International Science Foundation (Фонд Сороса)

9. Руководство аспирантами, защитившими кандидатские диссертации

Паламарчук Е.С. «Вероятностные критерии оптимальности в линейных управляемых системах и их применение к моделям с временными предпочтениями экономических агентов» (специальность 08.00.13 – «Математические и инструментальные методы экономики (физико-математические науки)»), 2013 г.

Куркина А.О. «Стохастические модели управления инвестициями страховой компании без использования займов» (специальность 01.01.05 – «Теория вероятностей и математическая статистика»), 2011 г.

Левочкина М.С. «Стохастическая оптимальность в задаче линейного регулятора, возмущенного последовательностью зависимых случайных величин» (специальность 01.01.05 – «Теория вероятностей и математическая статистика»), 2006 г.

10. Область научных интересов

Стохастическая оптимизация, теория риска, математическая теория страхования, стохастические модели и стохастическое управление.

11. Учебные курсы

Моделирование микроэкономических процессов, моделирование макроэкономических процессов, Стохастический анализ и моделирование, Актуарные расчеты

12. Участие в научных мероприятиях

The Eleventh Bachelier Colloquium on Mathematical Finance and Stochastic Calculus, Metabief, France, January 16-21, 2017;

Третий Российский экономический конгресс, Москва, 19-23 декабря 2016;

V Международная молодежная научно-практическая конференция «Математическое и компьютерное моделирование в экономике, страховании и управлении рисками», Саратов, 9-12 ноября 2016;

VIII Московская международная конференция по Исследованию Операций (ORM 2016), 17-22 октября 2016;

Второй Российский экономический конгресс, Суздаль, февраль 2013;

Международная конференция «Теория вероятностей и ее приложения» (посвященная столетию со дня рождения Б.В.Гнеденко), Москва, 26-30 июня 2012;

International Conference on Differential and Difference Equations and Applications (Conf. in honour of Prof. Ravi P. Agarwal), Ponta Delgada, Portugal, July 2011;

The Fourth Bachelier Colloquium on Mathematical Finance and Stochastic Calculus, Metabief, France, January 2010;

Первый Российский экономический конгресс, Москва, декабрь 2009;

5th International Fergana Conference "Limit Theorems of

Probability Theory and its Applications", Fergana, Uzbekistan, May 2005;

Fifteenth International Conference "Spectral and Evolution Problems", (Crimean Autumn Mathematical School-Symposium), Sevastopol, Ukraina, September 2004;

Шестая международная петрозаводская конференция "Вероятностные методы в дискретной математике", Петрозаводск, июнь 2004;

Всероссийский симпозиум по прикладной и промышленной математике: VIII, Сочи-Адлер, октябрь 2007; IV, Сочи, 2003; III, Сочи, 2002; I, Сочи, 2000;

Всероссийская школа-коллоквиум по стохастическим методам: V, Йошкар-Ола, декабрь 1998; IV, Уфа, август-сентябрь 1997.

13. Основные научные публикации

(до 1995 - под фамилией Конюхова Т.А.)

1. Asymptotic investment behaviors under a jump-diffusion risk process. – North American Actuarial Journal, 2017 (to appear) (with Sh.Luo).
2. Вязкостные решения интегродифференциальных уравнений для вероятности неразорения. – Теория вероятностей и ее применения. 2015. Т. 60. № 4. С. 802-810 (совместно с Кабановым Ю.М.)
3. Singular initial-value and boundary-value problems for integrodifferential equations in dynamical insurance models with investments. - Journal of Mathematical Sciences. 2016. Vol.218. No.4. P.369-394 (with Konyukhova, N.B. and Kurochkin, S.V.)
4. Динамические модели страхования с учетом инвестиций: сингулярные задачи с ограничениями для интегро-дифференциальных уравнений. - Ж. вычисл. матем. и матем. физ. 2016. Т.56. № 1. С.47-98 (совместно с Конюховой Н.Б., Курочкиным С.В.)
5. Survival probability in the life annuity insurance model with stochastic return on investments. – CEUR-WS, Vol. 1726. The proceedings of the Workshop on Computer Modelling in Decision Making (CMDM 2016). P. 1-12 (with Konyukhova, N.B. and Slavko, B.V.).
6. Asymptotic investment behaviors under a jump-diffusion risk process, 2015, Cornell University Library: arXiv:1502.02286 [q-fin.PM] (with Sh.Luo).
7. Risky investment for insurers and sufficiency theorems for the survival probability. – Markov Processes and Related Fields, 2014, v. 20, Issue 3, с. 505-525.
8. Optimal constrained investment in the Cramer-Lundberg model. - Scandinavian Actuarial Journal, 2014, v. 2014, Issue 5, p. 383-404 (with C.Hipp, Sh.Luo, M.Taksar).
9. Сингулярные начальные и краевые задачи для интегродифференциальных уравнений в динамических моделях страхования с учетом инвестиций. – Современная математика. Фундаментальные направления, 2014, т. 53, с. 5-29 (совместно с Конюховой Н.Б., Курочкиным С.В.) .

10. О стохастической оптимальности для линейного регулятора с затухающими возмущениями. - Автоматика и телемеханика, 2013, № 4, с. 110-128 (совместно с Паламарчук Е.С.).
11. Singular problems for integro-differential equations in dynamic insurance models. Springer Proceedings in Mathematics. Proc. Intern. Conf. on Differential and Difference Equations and Applications (in honour of Prof. Ravi P. Agarwal) (Azores University, Ponta Delgada, Portugal, July 4-8, 2011), Springer, 2013, v. 47, p. 27-44 (with Konyukhova, N. and Kurochkin, S.).
12. Сингулярная краевая задача для интегродифференциального уравнения в модели страхования со случайными премиями: анализ и численное решение. - Ж. вычисл. матем. и матем. физ., 2012, т.52, № 10, с.1812-1846 (совместно с Конюховой Н.Б., Курочкиным С.В.).
13. Сингулярная начальная задача для линейного интегродифференциального уравнения, возникающего в моделях страховой математики. - Intern. Scientific Journal Spectral and Evolution Problems (Simferopol: Taurida National V.Vernadsky University), 2011, v. 21, No 1, p. 40-54 (совместно с Конюховой Н.Б., Курочкиным С.В.).
14. Optimal constrained investment in the Cramer-Lundberg model, 2011, Cornell University Library, arXiv:1112.4007v1 [q-fin.PM] (with C.Hipp, Sh.Luo, M.Taksar)
15. О проблеме оптимального управления инвестициями в динамических моделях страхования. II. Модель Крамера-Лундберга с экспоненциальным распределением размера требований. – Обзорение прикладной и промышленной математики. 2010, т. 17, вып. 1, с. 3-24 (совместно с Конюховой Н.Б., Куркиной А.О).
16. О проблеме оптимального управления инвестициями в динамических моделях страхования. I.Различные инвестиционные стратегии и вероятность разорения. – Обзорение прикладной и промышленной математики. 2009, т. 16, вып. 6, с. 961-981 (совместно с Конюховой Н.Б., Куркиной А.О).
17. Динамические модели страхования: различные инвестиционные стратегии и вероятность разорения. – Российский экономический конгресс. Сборник докладов участников, ИЭ РАН, 2009, e-print (совместно с Куркиной А.О.)
18. Стохастическая оптимальность в задаче линейного регулятора, возмущенного последовательностью зависимых случайных величин. Дискретная математика. 2006, т. 18, вып. 1, с.126-145 (совместно с Левочкиной М.С.).
19. О минимизации вероятности разорения при выборе инвестиционных стратегий, не использующих заимствования. – In: Spectral and Evolution Problems: Proceedings of the Fifteenth Crimean Autumn Mathematical School-Symposium (KROMSH), Simferopol, 2005, v. 15, p.167-174 (совместно с Куркиной А.О.).
20. Об оптимальности по вероятности и почти наверное для процессов со свойством связности. I. Случай дискретного времени. Теория вероятностей и ее применения. 2005, т. 50, в. 1, с. 3-26 (соавтор - Ротарь В.И.).
21. Об оптимальности по вероятности и почти наверное для процессов со свойством связности. II. Случай непрерывного времени. Теория вероятностей и ее применения. 2005, т. 50, в. 2, с. 209-223 (соавтор - Ротарь В.И.).
22. Об асимптотических вероятностных критериях оптимальности в задаче управления пенсионным фондом. Материалы V Международной Ферганской Конференции «Предельные теоремы теории вероятностей и их приложения». Ташкент, 2005, с. 82-86 (совместно с Левочкиной М.С.).
23. О стохастической оптимальности для линейно-квадратического регулятора. Теория вероятностей и ее применения. 2003, т. 48, в. 4, с. 661-675 (совместно с Кабановым Ю.М., Пресманом Э.Л.).

24. Об условиях асимптотической оптимальности по вероятности и почти наверное в модели управляемого диффузионного процесса. Автоматика и телемеханика. 1999, вып. 2, с. 46-56 (соавтор - Ротарь В.И.).
25. Асимптотически оптимальные по распределению управления для линейной стохастической системы с квадратичным функционалом. Автоматика и телемеханика. 1997, вып. 3, с. 106-115 (совместно с Пресманом Э.Л.).
26. Асимптотически оптимальные по вероятности управления в задаче о линейном регуляторе с переменными параметрами. Автоматика и телемеханика. 1994, вып. 2, с. 110-120.
27. Управления, асимптотически оптимальные по вероятности и почти наверное в задаче о линейном регуляторе. Автоматика и телемеханика. 1992, вып. 6, с. 65-78 (соавтор - Ротарь В.И.)