

Биография — Сергей Николаевич Смирнов



[Сергей Николаевич Смирнов](#) (12.04.1955, г. Севастополь)

— доцент кафедры системного анализа ВМК МГУ, профессор кафедры страхования Государственного университета - Высшей школы экономики.

По окончании Ленинградского Нахимовского военно-морского училища (1971) поступил в Высшее военно-морское училище радиоэлектроники им. А. С. Попова. В 1973 г. был комиссован по состоянию здоровья и поступил в Московский государственный университет на факультет вычислительной математики и кибернетики. Окончил факультет ВМК с отличием (1978), его аспирантуру по кафедре математической статистики (1981).

Кандидат физико-математических наук (1982), тема диссертации: «Предельные теоремы для марковских процессов и их приложения» (научный руководитель Г. П. Климов). Учёное звание - доцент (1994).

В МГУ работает с 1981 г.: ассистент кафедры математической статистики факультета ВМК (1981-1992), доцент кафедры системного анализа (с 1992, с 1997 - по совместительству). Основные читаемые курсы: «Стохастический анализ и моделирование» для студентов 3-4 к., «Элементы финансовой математики» для 4-5 к.

В 1986-1989 гг. преподавал в университете г. Антананариву (Мадагаскар). В 1991 г. проходил стажировку во Франции в Университете Paris-7 и работал в лаборатории CERMA.

Вице-президент Общества Финансовых Аналитиков и Прогнозистов (Москва). Член правления Гильдии Инвестиционных и Финансовых Аналитиков (Москва). В 2001 г. избран членом Европейской комиссии по облигациям (European Bond Commission). Член комитета Professional Risk Management International Association (PRMIA) по образованию и стандартам.

С.Н. Смирнов работал начальником сектора анализа конъюнктуры рынков Казначейства банка Менатеп (1997-1998). Отвечал за ведение торгового и инвестиционного портфелей, за аналитические обзоры финансовых рынков, за проект создания интегрированной системы управления казначейства. Вице-президент фонда Содействия социальным и экономическим

реформам, ответственный за связь с финансовыми организациями (1998-1999). Первый заместитель председателя правления ЭЛБИМ банка (1999), курировал департамент управления ресурсами, департамент международных корреспондентских отношений, работу отделений и филиалов банка. В 1999-2000 гг. - начальник управления рынка стандартных контрактов Московской межбанковской валютной биржи. Руководил проектом по возобновлению торгов в Секции срочного рынка ММВБ.

С сентября 2000 г. по январь 2002 г. - директор российского отделения GARP (Global Association of Risk Professionals), член экзаменационного комитета GARP по международной сертификации финансовых риск-менеджеров FRM (Financial Risk Manager).

Член наблюдательного совета ОАО Управляющая Компания «Пифагор» (2001-2002), где курировал проект создания системы поддержки принятия решений при управлении портфелем опционов и фьючерсов на западных электронных биржах (LIFFE, EUREX и др.). С января 2002 г. - директор российского общества риск-менеджеров - регионального отделения PRMIA - международной ассоциации специалистов по управления финансовыми рисками.

Основные научные результаты получены С. Н. Смирновым в следующих областях: несмещённое оценивание в статистических задачах теории надежности, эргодические теоремы для марковских процессов, модели теории массового обслуживания, метод пробных функций для марковских процессов, каплинг-метод для случайных процессов, теория и численные методы решения уравнения Больцмана, моделирование прохождения пучка заряженных частиц через монокристалл с учётом каналирования и рассеивания, большие отклонения для стохастических дифференциальных уравнений, игровая интерпретация задачи ценообразования и хеджирования обусловленных обязательств, оптимальное маржирование портфелей производных финансовых инструментов, численное решение дифференциальных уравнений в частных производных для задачи ценообразования опционов, методы построения временной структуры процентных ставок для однородной группы облигаций при помощи монотонных сплайнов, модели рыночных рисков и управление портфелем в условиях низкой ликвидности.

Подготовил двух кандидатов наук и одного Docteur en Sciences (Франция).

Имеет более 40 научных работ, в том числе: К обоснованию одного стохастического метода решения пространственно-однородного уравнения Больцмана // ЖВМиМФ, 1989, т.29, №2, с.270-276; Jonction maximale en distribution dans le cas markovien // Probab. Th. Rel. Fields, 1990, v.84, №4, p.491-503 (соавт. Harison V.); Petites perturbations de systemes dynamiques et algebres de Lie nilpotentes. Une extension des estimations de Doss et Strook // Semin. de Probab. XXVIII, Eds. J. Azema, P. A. Meyer, M. Yor, Lect. Notes Math. 1583, Springer-Verlag, 1994, p.49-72 (соавт. Rabeherimanana T. J.); Стохастическая модель прохождения ультрарелятивистских электронов через толстый монокристалл // Математ. моделирование, 2000, т. 12, № 9, с. 25-44 (соавт. Лукшин А. В., Маслов А. К., Полиматиди И. В.).

Source URL: <http://sa.cs.msu.su/staff/smirnov/bio>