Назаров Иван Николаевич

Опыт работы — 6 лет 5 месяцев

Сентябрь 2015 - настоящее время 9 месяцев

Лаборатория 10, Институт Проблем Передачи Информации   
РАН, Москва (iitp.ru)

Стажёр-Исследователь

Проект 2015/09 - 2016/02, 2016/05 - настоящее время:

Разработка библиотеки предсказательного моделирования и раннего обнаружения неполадок примениительно к аэрокосмической отрасли:

-- решение кейсов по машинному обучению и аналзу данных, необходимых для прохождения сертификации TRL5;

-- проработка архитектуры и интерфейса библиотеки;

-- усоврешенствования некоторых алгоритмнов и эффективной внедрение в библиотеку;

-- ппроведение трейнинга по библиотеке для заказчика;

Проект 2015/12 - настоящее время:

Сотрудничество в рамках пакета долгосрочного симулирования для задач планирования в угледобывающей отрасли:

-- аналитика и внедрение композитной макорэкономической модели;

-- формирование и разработка пакета в R, вместе с пользовательской документацией, для поставки заказчику.

Мини-проекты:

Сотрудничество по направлению применения машинного обучения и алгоритмов

к торговле биржевыми инвестиционными фондами:

-- проведение численных симуляционных экспериментов;

-- подготовка отчётов о результатах сравнения стратегий.

Научные работы:

Магистерская диссертация по теме "Конформные методы в многомерных линейных моделях и детектировании аномалий" (конформные методы используют минимальные вероятностные предпосылки). В рамках проекта достигнуты следующие цели:

-- выведенны необходимые формулы для быстрого построения конформных доверительных интервалов для Ядерной Шребневой Регрессии;

-- произведена эффективная реализация построения доверительных интревалов;

-- проведено эмпирическое сравнение с байесовкими интервалами на основе регрессии на гауссовких процессах;

Полученные выводы обосновывают практическое применение конформных доверительных интервалов в детектировании аномалий.

Май 2013 — Август 2015 (2 года 4 месяца)

GlowByte Consulting, Москва (glowbyteconsulting.com)

Бизнес-аналитик

Проект 2013/04-2014/02:

архитектор и главный разработчик модуля статистических вычислений и рыночного симулирования для системы анализа срочного рынка ЦБ РФ.

Проект 2014/03-2015/08:

анализ и внедрение бизнес-логики объектов хранилища данных в рамках миграции отчётности крупного банка на новое корпоративное хранилище данных.

Январь 2010 — Апрель 2013 (3 года 4 месяца)

Институт финансовых исследований, Москва (www.ifs.ru)

Аналитик

Проведение эконометрических исследований, статистическая оценка и разработка математических моделей, сценарный анализ, прогнозирование, визуализация данных и результатов (с использованием различных статистических программ, таких как EViews, R);

Информационно-аналитическая поддержка руководства компании;

Подготовка регулярных аналитических комментариев по макроэкономической тематике;

Работа в рамках проекта "Исследование роли ОАО "Газпром" и стратегии России как одного из крупнейших экспортёров газа" (рабочий язык : Английский). По результатам проекта опубликован манускрипт "Gazprom: An Energy Giant and its Challenges in Europe" (ISBN-13: 978-1137461094).

Научные публикации, аналитические работы и заметки:

1. "Транзит природного газа: модель торга" (применение теории игр к проблеме транзита газа; публикация в журнале "Экономика и математические методы", Выпуск 4, октябрь-декабрь 2010 г.)

2. "Теория экстремальных значений в задаче оценки рыночного риска", 2010г. (оценка VAR и ES при помощи моделей семейства GARCH; для внутреннего использования)

3. "Применение модели переключения режимов при моделировании динамики цен на нефть", 2011г. (оценка модели Markov Switching AR; для внутреннего использования)

4. "Навык или везение: эффективность отечественных открытых паевых фондов акций", 2012-2013гг. (применение модели 4-factor CAPM и имитационного исследования; для внутреннего использования)

5. "Индекс Финансового Стресса (Россия)", 2011-2012гг. (разработка методологии и комплекса оценки).

6. Ряд заметок для сайта компании, 2010-2013гг. ("ЦБ не справляется с темпами инфляции", "Сорвётся ли США с 'Обрыва'?" и др.)

7. "Сланцевый газ в Пенсильвании", 2013г. (анализ текущей ситуации и тенденций; для внутреннего использования)

8. "Российская газовая отрасль" и "Анализ российского рынка газа" (2 главы на английском языке, опубликовано в 2014 г.)

Образование

2014-2016 Магистр

Национальный исследовательский университет "Высшая школа экономики", Москва

Компьютерных Наук, Прикладная математика и информатика

программа Науки о Данных

2007-2009

Национальный исследовательский университет "Высшая школа экономики", Москва

Экономический факультет, Математические Методы Анализа Экономики

программа "Математические методы в экономике""

2003-2007 Бакалавр

Национальный исследовательский университет "Высшая школа экономики", Москва

Экономический факультет, Математические Методы Анализа Экономики

кафедра "Математические методы в экономике"

Знание языков

Русский — родной

Английский — свободно

Ключевые навыки

Навыки

Техническая документация Python SQL Анализ данных

Английский язык Письменный перевод Деловая переписка

Работа в команде Математическая статистика Линейное программирование Математическое моделирование Работа с большим объемом информации Подготовка презентаций Устный перевод Аналитические исследования Data Analysis Big Data Data Mining Mathematical Statistics Mathematical Programming

Дополнительная информация

Обладаю теоретическими знаниями и широким опытом решения практических задач в области анализа данных и машинного обучения, применению численных алгоритмов.

Обладаю опытом решения прикладных математических и статистических задач, анализа данных и постановки численных экспериментов на R или с использованием стэка Python, numpy, scipy, matplotlib, scikit-learn. Знание и практическое применение языков C, python, R и SQL.

Имею опыт практической автоматизация сбора данных, анализ и визуализация статистических расчётов и результатов исследований.

Имею опыт проектирования и разработки бизнес-решения для работы с имитационным моделированием, статистическими методами, прогнозированием и анализом финансовых временных рядов.

Владеию навыками работы и прогрммирования в пакете эконометрического анализа Eviews, навыками написания технической документации (опытный пользователь MS Office, верстка документов LaTeX).

Личные качества:

- обучаемость, ответственность и аналитический склад ума ;

- внимание к деталям и глубокому пониманию предметной области и применяемой методологии ;

- любознательность ;

Огромное желание решать прикладные задачи в области на стыке математической статистики, моделирования и компьютерных наук, одновременно продолжая расширять кругозор современными методами анализа больших данных и алгоритмами их обработки и численного анализа.