



UNIVERSITATEA
TEHNICĂ
DE CONSTRUCȚII
BUCUREȘTI
Departamentul
de Matematica
și Informatică



UNIVERSITATEA
DIN BUCUREȘTI
Facultatea de
Matematică și
Informatică



ACADEMIA
DE STUDII ECONOMICE
DIN BUCUREȘTI
Departamentul
de Matematici Aplicate



ACADEMIA ROMÂNĂ
Institutul de Statistică
Matematică și Matematică
Aplicată, „Gheorghe Mihoc-
Caius Iacob”

A 17-a CONFERINȚĂ A SOCIETĂȚII DE PROBABILITĂȚI ȘI STATISTICĂ DIN ROMÂNIA

Universitatea Tehnică de Construcții București
25 aprilie 2014

SPONSOR PRINCIPAL:
CENTRUL DE CERCETĂRI MATEMATICE AVANSATE
FUNDAMENTALE ȘI APLICATIVE ASE DIN BUCUREȘTI

Președinte: Acad. Marius Iosifescu

Comitetul științific

*Acad. Ioan Cuculescu
Mioara Buiculescu
Monica Dumitrescu
Denis Enăchescu
Iulian Mircea
Eugen Păltănea
Vasile Preda
Romică Trandafir
Maria Tudor
Ion Vaduva
Gheorghiu Zbăganu*

Comitetul de organizare

*Alexandru Agapie
Sorin Demetriu
Pavel Matei
Iuliana Iatan
Daniel Ciuiu
Roxana Dobre
Bogdan Sebacher
Silvia Dedu
Mierluș Mazilu
Silviu Laurențiu Vasile*

PROGRAMUL CONFERINȚEI SPSR 2014
Vineri 25 aprilie – Facultatea de Hidrotehnică, UTCB

Secțiuni:

- 1. Probabilități și Procese Stocastice**
- 2. Statistică**
- 3. Optimizări, Matematici Financiare și Actuarial**

9:00 – 10:00 *Deschiderea Conferinței (sala II 7)*

Mesajul Rectorului UTCB

Cuvântul Acad. Ioan Cuculescu: Universitatea din București la 150 de ani

Mesajul Acad. Marius Iosifescu: Centrul de Statistică Matematică, 50 de ani de la înființare

Prof. Tiberiu Postelnicu, Dr. Marius Rădulescu: File din istoria Centrului de Statistică Matematică al Academiei Române

10:00 – 10:45 *Adunare generală a SPSR (sala II 7)*
Ordinea de zi: raport financiar, alegerea noului trezorier, completarea Biroului de conducere

10:45 – 11:00 Pauză de cafea

11:00 – 12:30 Comunicări pe secțiuni (salile II 7, II 5, I 2)

12:30 – 14:00 Masa la Cantina-restaurant UTCB

14:00 – 15:15 Comunicări pe secțiuni (salile II 7, II 5, I 2)

15:15 – 15:30 Pauză de cafea

15:30 – 17:00 Comunicări pe secțiuni (salile II 7, II 5, I 2)

17:00 Cocktail

COMUNICĂRI PE SECȚIUNI

Secțiunea Probabilități și Procese Stocastice (Sala II 7)

Conduce: Acad. Ioan Cuculescu

11:00 – 11:15

Alexandru Amarioarei (University of Lille 1)

Efficient simulation methods for scan statistics: a comparison study

11:15 – 11:30

Alexandru Agapie (ASE Bucuresti, ISMMA)

Stationary Distribution for Synchronous Cellular Automata

11:30 – 11:45

Udrea Paun (ISMMA)

Upper bounds for expectation

11:45 – 12:00

Monica Patriche (Universitatea din Bucuresti)

Random fixed point theorems under mild continuity assumptions

12:00 – 12:15

George Haiman, Cristian Preda (Universite Lille 1)

Scan statistics generated by some Gaussian stationary

12:15 – 12:30

Vlad Stefan Barbu (Universite de Rouen)

Reliability Modeling with Hidden Markov and semi-Markov Chains

Secțiunea Statistică (Sala II 5)

Conduce: Monica Dumitrescu, Ciprian Tudor

11:00 – 11:15

Daniel Ciuiu (Universitatea Tehnica de Constructii Bucuresti; Institutul de Prognoza Economica)

Bayesian Inference for Copulas, and Economic Applications

11:15 – 11:30

Radu Drobot, Romica Trandafir si Daniel Ciuiu (Universitatea Tehnica de Constructii Bucuresti; Universitatea Tehnica de Constructii Bucuresti si Institutul de Prognoza Economica)

The effect of the climatic variability on the maximum discharges

11:30 – 11:45

Stefania Constantinescu (Universitatea Tehnică de Construcții București)

Rezolvarea problemei de programare liniară bilevel cu metoda Monte Carlo

11:45 – 12:00

Romica Trandafir, Ion Vaduva (Universitatea Tehnica de Constructii Bucuresti; Universitatea Bucuresti)

Applying Multiple Attribute Decision Making Problems to Arrange a Garbage Grave

12:00 – 12:15

Mircea Dragulin, Romica Trandafir (Universitatea Tehnica de Constructii Bucuresti)

About some Extensions of Lindley Distribution

Secțiunea Optimizări, Matematici Financiare și Actuarial (Sala I 2)
Conduce: Gheorghita Zbaganu

11:00 – 11:15

Iulian Mircea, Mihaela Covrig, Laura Elly Naghi (Academia de Studii Economice)

Life insurance pricing with fuzzy random variables

11:15 – 11:30

Mihaela Covrig, Laura Elly Naghi, Iulian Mircea (Academia de Studii Economice)

Some perturbed risk models with reinvested surplus

11:30 – 11:45

Ana Maria Raducan, Raluca Vernic, Gheorghita Zbaganu (Institute for Mathematical Statistics and Applied Mathematics, Ovidius University of Constanta, Univ)

Recursive calculation of ruin probabilities at or before claim instants for non-identically distributed claims

11:45 – 12:00

Elena-Gratiela Robe-Voinea, Raluca Vernic (Scoala Doctorala de Matematica, Universitatea Bucuresti; Universitatea Ovidius Constanta)

Fast Fourier Transform for Multivariate Aggregate Losses

12:00 – 12:15

Marius Radulescu, Constanta Zoie Radulescu (Institute of Mathematical Statistics and Applied Mathematics)

Mean-variance models for crop planning

12:15 – 12:30

Andreea Madalina Stancu, I.M. Stancu-Minasian (Institutul de Statistica Matematica si Matematica Aplicata "Gheorghe Mihoc-Caius Iacob")

Optimality criteria and duality in multiobjective fractional programming problems with type-I functions

Secțiunea Probabilități și Procese Stocastice (Sala II 7)

Conduce: George Haiman

14:00 – 14:15

Bogdan Sebacher (UTCB)

An adaptive plurigaussian simulation (APS) model for geological uncertainty quantification using the Ensemble Kalman Filter (EnKF)

14:15 – 14:30

Corina Grosu, Marta Grosu (Universitatea Politehnica Bucuresti)

Embedding moment generating functions in indefinite inner product spaces

14:30 – 14:45

Eugen Păltănea (Universitatea Transilvania din Brașov)

On Poisson δ -shock type models

14:45 – 15:00

Alexei Leahu, Bogdan Gheorghe Munteanu (Universitatea Tehnica a Moldovei, Chisinau; Academia Forțelor Aeriene "Henri Coandă", Brașov)

About the maximum and minimum power series distributions

15:00 – 15:15

Aurelia Florea (Universitatea din Craiova)

Inequalities based on the convex ordering

Secțiunea Statistică (sala II 5)

Conduce: Ion Văduva

14:00 – 14:15

Gabriela-Roxana Dobre, Radu Drobot (Universitatea Tehnica de Constructii Bucuresti)

R Language: Statistical computing and graphics for modeling of hydrologic time series

14:15 – 14:30

Sorin Demetriu (Universitatea Tehnica de Constructii Bucuresti)

Time – Frequency Analysis of Earthquake Response Records from Instrumented Buildings

14:30 – 14:45

Luiza Badin, Cinzia Daraio, Leopold Simar (ASE Bucuresti, Universitatea Sapienza din Roma, Universitatea Catolica Louvain)

Bandwidth Selection Methods for Conditional Efficiency Measurement

14:45 – 15:00

Emil Simion (Universitatea Politehnica din Bucuresti)

Probability, Statistics & Cryptology (proof, estimate and apply)

15 :00 – 15:15

Aida Toma (ASE Bucuresti si ISMMA)

Model Selection Criteria using Divergences

Secțiunea Optimizări, Matematici Financiare și Actuarial (Sala I 2)
Conduce: Stefan Mititelu

14:00 – 14:15

Cristian Niculescu, Vasile Preda, Costel Bălcău (Universitatea Bucuresti)
Maximizing the Tsallis entropy with certain grade correlation coefficients

14:15 – 14:30

Costel Bălcău, Vasile Preda, Cristian Niculescu (Universitatea Bucuresti, Universitatea din Pitesti, Universitatea Bucuresti)
Optimization of generalized weighted entropies with linear constraints

14:30 – 14:45

Ovidiu Veghes (Academia de Studii Economice Bucuresti)
Indici de putere bazati pe valoarea Shapley

14:45 – 15:00

Sorina Gramatovici, Vasile Preda (A.S.E.Bucuresti, Universitatea Bucuresti)
Some parametric sufficient weak ε - efficiency conditions for multiobjective fractional programming problems with generalized (F, ρ, θ) - convexity

15:00 – 15:15

Toni-Catalin Mihalcea (Universitatea Bucuresti)
Higher-order optimality conditions and duality results for a vector optimization problem over cones

Secțiunea Probabilități și Procese Stocastice (Sala II 7)

Conduce: Mioara Buiculescu

15:30 – 15:45

Iulian Cîmpean, Lucian Beznea (Institutul de Matematica Simion Stoilow al Academiei Romane)

On Bochner-Kolmogorov Theorem

15:45 – 16:00

Romeo Negrea, Vasile Marinca (Universitatea Politehnica Timisoara)

On analytical solutions of the non-linear Black- \perp Scholes equation

16:00 – 16:15

Muhammad Sheraz (Universitatea din Bucuresti)

Power Options and Black-Scholes Partial Differential Equation

16:15 – 16:30

Ionela Marinela Marinescu (Academia de Studii Economice, Bucuresti)

A filtering problem for SDEs with unbounded jumps

16:30 – 16:45

Răzvan Sfetcu (Universitatea din București)

Kothe-Bochner spaces and Schauder bases. Optimal numerical treatment

16:45 – 17:00

Anca Plavitu (Universitatea din București)

Lambda-measures. The case of at most countable spaces

Secțiunea Statistică (sala II 5)

Conduce: Cristian Niculescu

15:30 – 15:45

Voicu Boscaiu (ISMMA)

Comment on statistical significance of empirical data

15:45 – 16:00

Iuliana Iatan, Maarten de Rijke (UTCB; UvA)

Research on Information Retrieval using Neural Networks

16:00 – 16:15

Alexandra Zbaganu (Universitatea Politehnica Bucuresti)

Tehnici de detectie contur

16:15 – 16:30

Alin Marian Rusu (Universitatea din București)

Statistical inference for Moyal type distributions

16:30 – 16:45

Crina Țuculan Diaconu (Universitatea din București)

On some entropic criteria in sampling theory

16:45 – 17:00

Silviu Laurentiu Vasile (Institutul de Statistica Matematica si Matematica Aplicata)

Some aspects of random databases

Secțiunea Optimizări, Matematici Financiare și Actuariat (sala I 2)
Conduce: I.M. Stancu Minasian, Alexei Leahu

15:30 – 15:45

Bogdan Biolan (Universitatea Bucuresti)

On Nash Equilibrium by Lagrange multipliers approach using interval functions

15:45 – 16:00

Diana-Elena Stanciu (Universtatea din Bucuresti)

An equivalence result between vector variational inequalities and vector optimization problem

16:00 – 16:15

Florentin Serban (ASE Bucuresti, Universitatea Bucuresti)

Optimizarea unui portofoliu folosind functionale neliniare scalare

16:15 – 16:30

Silvia Dedu (Bucharest University of Economic Studies)

Restricted optimal retention under minimizing limited risk measures

16:30 – 16:45

Cristinca Fulga (Academia de Studii Economice)

Mean-Risk Portfolio Optimization and Preferences

16:45 – 17:00

Ioana Ileana Panait (Universitatea din București)

Optimization with Ben Tal-Avriel operations