

**Сведения о ведущей организации и официальных оппонентах**  
на диссертацию Иванова Михаила Юрьевича  
«Максимизация ожидаемой полезности в экспоненциальной модели Леви» по  
специальности 01.01.05 – теория вероятностей и математическая статистика.

**Ведущая организация:** ФГБОУ Центральный экономико-математический институт РАН, 117418 Москва, Нахимовский проспект, 47, тел.: +7 (499) 129 1011.

Аркин Вадим Иосифович (e-mail: arkin@semi.rssi.ru), кандидат физико-математических наук. Старший научный сотрудник, заведующий лабораторией стохастических моделей экономики Центрального экономико-математического института РАН.

Основные публикации:

1. Аркин В. И. Пороговые стратегии в задачах оптимальной остановки одномерных диффузионных процессов // Теория вероятностей и ее применения, 2014, т. 59, №. 2, с. 365-374.
2. Аркин В. И., Слостников А.Д. Компенсация повышенных процентов за кредит с помощью механизмов государственной поддержки // Журнал Экономика и математические методы (ЭММ), 2014, т. 50, №. 4, с. 104-111.
3. Аркин В. И., Слостников А.Д. Моделирование механизма государственных гарантий и кредитной политики банка при инвестировании рискованных проектов // Журнал Экономика и математические методы (ЭММ), 2014, т. 50, №. 3, с. 105-118.
4. Аркин В. И., Слостников А. Д. Пороговые правила остановки диффузионных процессов и задача Стефана // Доклады Академии наук, Академический научно-издательский, производственно-полиграфический и книгораспространительский центр Российской академии наук" Издательство " Наука" (Москва), 2012, т. 446, №. 3, с. 247.

**Официальный оппонент** Рохлин Дмитрий Борисович (e-mail: rokhlin@math.rsu.ru). Доктор физико-математических наук, специальность 01.01.05. Профессор кафедры высшей математики и исследования операций Южного федерального университета.

Основные публикации

1. Rokhlin D.V. Central limit theorem under uncertain linear transformations // Statistics and Probability Letters, 2015, v. 107, p. 191–198.
2. Rokhlin D.V. Stochastic Perron's method for optimal control problems with state constraints // Electronic Communications in Probab, 2014, v. 19, p. 1-15.

3. Rokhlin D. B. Verification by stochastic Perron's method in stochastic exit time control problems // Journal of Mathematical Analysis and Applications, 2014, v. 419, №. 1, p. 433-446.
4. Rokhlin D. B. On the game interpretation of a shadow price process in utility maximization problems under transaction costs // Finance and Stochastics, 2013, v. 17, №. 4, p. 819-838.

**Официальный оппонент** Иванов Роман Валерьевич (e-mail: r\_ivanov@ipu.ru). Кандидат физико-математических наук, специальность 01.01.05. Старший научный сотрудник лаборатории № 38 Института проблем управления им. В.А. Трапезникова РАН.

**Основные публикации**

1. Иванов Р. В. О предсказании максимума семимартингала и оптимальном моменте продажи акции // Автоматика и телемеханика, 2015, №. 7, с. 69-77.
2. Ivanov R. V. Closed Form Pricing of European Options for a Family of Normal-Inverse Gaussian Processes // Stochastic Models, 2013, v. 29, №. 4, p. 435-450.
3. Ano K., Ivanov R. V. On predicting the ultimate maximum for exponential Lévy processes // Electronic Communications in Probability, 2012, v. 17, p. 1-9.
4. Иванов Р. В., Ширяев А. Н. О принципе дуальности для хеджирующих стратегий в диффузионных моделях // Теория вероятностей и ее применения, 2011, т. 56, №. 3, с. 417-448.

Ученый секретарь диссертационного совета  
Д 501.001.85 при МГУ им. М.В. Ломоносова,  
д.ф.-м.н., профессор



В.В. Власов