

ОТЗЫВ

об автореферате диссертации М. Ю. Иванова
“Максимизация ожидаемой полезности в экспоненциальной модели
Леви”, представленной на соискание ученой степени кандидата
физико-математических наук по специальности 01.01.05 — теория
вероятностей и математическая статистика

Диссертация М. Ю. Иванова представляет собой исследование в области стохастической финансовой математики и содержит полное решение важной для теории задачи максимизации полезности в безарбитражной экспоненциальной модели Леви для трех наиболее распространенных функций полезности — логарифмической, степенной и экспоненциальной. Значимость полученных результатов определяется не только тем, что эти задачи решены в полной общности, но и тем, что результаты второй и третьей глав диссертации могут быть использованы в качестве примеров, поясняющих определенные аспекты первой фундаментальной теоремы теории арбитража. Следует особо выделить решение задачи максимизации степенной полезности в главе 3, основанное на неожиданной идее — сведении ее к задаче нахождения эталонного портфеля посредством эквивалентной замены меры.

Результаты диссертации прошли существенную апробацию, в частности, опубликованы в 2-х статьях в журналах, рекомендуемых ВАК, и представлены на двух международных конференциях с участием ведущих ученых в области финансовой математики.

Содержание автореферата М. Ю. Иванова отвечает всем необходимым требованиям. В нем четко и ясно обозначены актуальность темы, цель исследования и обоснована научная новизна результатов исследования.

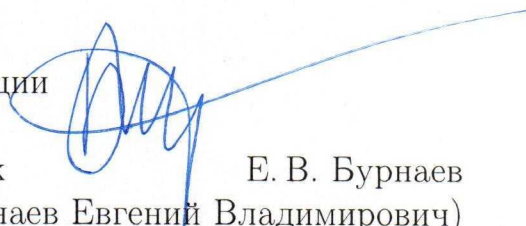
В целом, как показывает автореферат диссертации, соискатель успешно справился с поставленной задачей, продемонстрировав знание предмета исследования, умение ясно излагать свои выводы и предложения.

Таким образом, судя по автореферату, диссертационная работа представляет законченную научно-квалификационную работу, обладающую актуальностью, научной новизной, теоретической и практической значимостью, соответствует требованиям ВАК РФ, а ее ав-

тор, Михаил Юрьевич Иванов, заслуживает присвоения ему ученой степени кандидата физико-математических наук по специальности 01.01.05 — теория вероятностей и математическая статистика.

26 ноября 2015 г.

Заведующий сектором № 5
Института проблем передачи информации
им. А. А. Харкевича РАН,
кандидат физико-математических наук
Тел. +7 (495) 781 60 88
E-mail: burnaev@iitp.ru



Е. В. Бурнаев
(Бурнаев Евгений Владимирович)

ФГБУН Институт проблем передачи информации
им. А. А. Харкевича
Российской академии наук
127051, г. Москва, Большой Каретный переулок, д. 19, стр. 1
Тел. +7 (495) 650 42 25
Факс: +7 (495) 650 05 79
Сайт: iitp.ru

Подпись
Бурнаев Е. В.
УДОСТОВЕРЯЮ
Зав. канцелярией

