


СВЕДЕНИЯ О НАУЧНОМ РУКОВОДИТЕЛЕ

диссертационной работы Соболя Виталия Романовича

на тему: «Синтез оптимальных стратегий в задачах последовательного хеджирования колл-опционов при наличии полосы нечувствительности», представленной на соискание ученой степени кандидата физико-математических наук по специальности 05.13.01 – «Системный анализ, управление и обработка информации (авиационная и ракетно-космическая техника)»

Фамилия, имя, отчество	Год рождения, гражданство	Место работы, Должность	Ученая степень, ученое звание, шифр специальности	Основные работы по профилю диссертации
1	2	3	4	5
Кибзун Андрей Иванович	1951 г., гражданин РФ	Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Московский авиационный институт (национальный исследовательский университет)»	<p>Доктор физико-математических наук, диплом доктора наук ФМ № 003683 от 03.07.1987, протокол № 26д/2</p> <p>Профессор, аттестат профессора ПР № 004503 от 22.02.1990, протокол № 63/п</p> <p>Шифр специальности 01.01.11</p>	<p>1. А. И. Кибзун, В. Р. Соболев Двухшаговая задача хеджирования европейского колл-опциона при случайной длительности транзакций // Тр. ИММ УрО РАН. 2015. Т. 21. № 3. С. 164-174.</p> <p>2. А. И. Кибзун, В. Р. Соболев Модификация стратегии последовательного хеджирования. Распределение потерь хеджера // Автомат. и телемех. 2015. № 11. С. 34-50.</p> <p>3. А. Н. Игнатов, А. И. Кибзун Двухшаговая задача формирования портфеля ценных бумаг из двух рискованных активов по вероятностному критерию // Автомат. и телемех. 2015. № 7. С. 78-100.</p> <p>4. А. Н. Игнатов, А. И. Кибзун О формировании портфеля ценных бумаг с равномерным распределением по логарифмическому критерию с приоритетной рисковой составляющей // Автомат. и телемех. 2014. № 3. С. 87-105.</p>

ведущий научный сотрудник НИО-804,
заведующий кафедрой 804 МАИ,
д.ф.-м.н., профессор

 А. И. Кибзун

Председатель
диссертационного совета Д 212.125.04,
д.ф.-м.н., профессор

 А. В. Наумов

Ученый секретарь
диссертационного совета Д 212.125.04,
к.ф.-м.н.

 Н. С. Северина