

Сведения о научном руководителе
по диссертации Антипова Виктора Алексеевича
«О вероятностях разорения с инвестициями в рисковый актив»

Научный руководитель: Кабанов Юрий Михайлович

Ученая степень: доктор физико-математических наук

Ученое звание: профессор

Научная специальность: 01.01.05 Теория вероятностей и математическая статистика

Место работы: ФГБОУ ВО «Московский государственный университет имени М.В. Ломоносова», Московская школа экономики

Должность: профессор кафедры эконометрики и математических методов экономики

Адрес места работы: 119991, г. Москва, ул. Ленинские Горы, д.1, стр. 61.

Тел.: +7 (495) 510 52 67

E-mail: ykabanov@univ-fcomte.fr

Второе место работы: Фонд содействия развитию науки «Институт «Вега»

Должность: научный директор

Адрес места работы: 119234 г. Москва, ул. Ленинские горы, д. 1, строение 52, комната 417.

E-mail: info@vega-institute.org

Список основных научных публикаций по специальности и/или проблематике
оппонируемой диссертации за последние 5 лет:

1. Kabanov Yu, Legenkiy D., Promyslov P. *Distributional equations and the ruin problem for the Sparre Andersen model with investments*, 2026 // *Extremes*, том 29, с. 65-87.
2. Kabanov Yu., Sonin M. *On the entropy-minimal martingale measure in the exponential Ornstein–Uhlenbeck stochastic volatility model*, 2025 // *Annals of Operations Research*
3. Kabanov Yu., Promyslov P. *Ruin probabilities for a Sparre Andersen model with investments: the case of annuity payments*, 2023 // *Finance and Stochastics*, том 27, № 4, с. 887-902.
4. Kabanov Yu, Pergamenshchikov S. *On ruin probabilities with investments in a risky asset with a regime-switching price*, 2022 // *Finance and Stochastics*, том 26, № 4, с. 877-897
5. Kabanov Y, Pukhlyakov N. *Ruin probabilities with investments: smoothness, integro-differential and ordinary differential equations, asymptotic behavior*, 2022 // *Journal of Applied Probability*, том 59, № 2, с. 556-570.

Ученый секретарь диссертационного совета МГУ.011.3,
Е.Д. Алферова

Подпись, печать