

СВЕДЕНИЯ ОБ ОФИЦИАЛЬНОМ ОППОНЕНТЕ
по диссертации Артемова Алексея Валерьевича «Математические модели временных рядов с трендом в задачах обнаружения разладки», представленной на соискание учёной степени кандидата физико-математических наук по специальности 05.13.18 — математическое моделирование, численные методы и комплексы программ

Фамилия Имя Отчество	Житлухин Михаил Валентинович
Ученая степень	Кандидат физико-математических наук
Научная специальность	01.01.05 – Теория вероятностей и математическая статистика
Место работы	Федеральное государственное бюджетное учреждение науки Математический институт им. В. А. Стеклова РАН
Должность	Научный сотрудник отдела теории вероятностей и математической статистики
Список основных публикаций по теме диссертации	1. М. В. Житлухин, А. А. Муравлёв, А. Н. Ширяев, “О доверительных интервалах для момента “разладки” броуновского движения”, УМН, 71:1(427) (2016), 171–172. 2. M. V. Zhitlukhin, W. T. Ziemba, “Exit strategies in bubble-like markets using a changepoint model”, Quant. Finance Letters, 4:1 (2016), 47–52. 3. A. N. Shiryaev, M. V. Zhitlukhin, W. T. Ziemba, “When to sell Apple and the NASDAQ? Trading bubbles with a Stochastic Disorder Model”, Journal of Portfolio Management, 40:2 (2014), 54–63. 4. М. В. Житлухин, А. Н. Ширяев, “О существовании решений неограниченных задач об оптимальной остановке”, Стохастическое исчисление, мартингалы и их применения, Сборник статей. К 80-летию со дня рождения академика Альберта Николаевича Ширяева, Тр. МИАН, 287, МАИК, М., 2014, 310–319 5. М. В. Житлухин, А. Н. Ширяев, “Задачи об оптимальной остановке для броуновского движения с разладкой на отрезке”, ТВП, 58:1 (2013), 193–200. 6. М. В. Житлухин, А. Н. Ширяев, “Байесовские задачи о разладке на фильтрованных вероятностных пространствах”, ТВП, 57:3 (2012), 453–470.

15.12.2016

М. В. Житлухин

М. В. Житлухин

Подпись *Житлухина* и заверено:
Зав. отделом кадров *М. В. Житлухин*
МОСКВА