

Сведения об официальном оппоненте
по диссертации Чертока Андрея Викторовича
«Моделирование потоков заявок на финансовых рынках с помощью обобщенных процессов риска»
на соискание учёной степени кандидата физико-математических наук
по специальности 01.01.05 – теория вероятностей и математическая статистика

Леонидов Андрей Владимирович – доктор физико-математических наук, ведущий научный сотрудник Федерального государственного бюджетного учреждения науки Физического института им. П.Н. Лебедева Российской Академии Наук.

Адрес: 117924, г. Москва, Ленинский проспект, д. 53
Телефон: +7(499)783-37-19
e-mail: leonidov@lip.ru

Список основных публикаций оппонента по теме диссертации:

1. И. М. Дремин, А. В. Леонидов и В. А. Нечитайло, "О некоторых свойствах каскадных процессов со случайной интенсивностью", Краткие сообщения по физике ФИАН 31 (2011), 1.
2. A. Leonidov, V. Trainin, A. Zaitsev and S. Zaitsev, «Market Mill Dependence Pattern in the Stock Market: Multiscale Conditional Dynamics», Physica A 388 (2009), 4624.
3. А. Леонидов, «Путь к экономическому равновесию и эффективность финансовых рынков: взгляд физика», Вопросы экономики 11 (2009).
4. A. Leonidov, V. Trainin, A. Zaitsev and S. Zaitsev, «Market Mill Dependence Pattern in the Stock Market: Modeling of Predictability and Asymmetry via Multi-Component Conditional Distribution», Physica A 386 (2007), 240.
5. I. M. Dremin and A. V. Leonidov, «Volatility Dynamics of Wavelet-Filtered Stock Prices», Bull. Lebedev Phys. Inst. 1 (2008), 1.
6. I. M. Dremin and A. V. Leonidov, «On distribution of number of trades in different time windows in the stock market», Physica A 353 (2005) 388 [cond-mat/0409179].
7. A. Leonidov, «Long Memory in Stock Trading», Int. J. Theor. Appl. Finan. 7 (2004), 879.
8. A. V. Leonidov, «Alternation and Cascade Evolution in Fractals in Processes of Multiple Generation», Soviet Physics-Lebedev Institute Reports 7 (1989), 29.