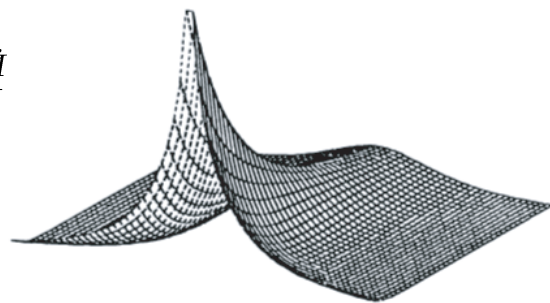




Кафедра ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель - член-корр. РАН, профессор А. Н. Ширяев

Программа на октябрь 2008 г.

22 октября — **Д.В. Орлов** (МГУ)

О двух подходах к когерентному риску вклада

Резюме.

В докладе сравниваются два подхода к оценке риска вклада для когерентных мер риска. А именно,

- прямой риск вклад

$$\rho^d(X; Y) = \lim_{\varepsilon \downarrow 0} \frac{\rho(Y + \varepsilon X) - \rho(Y)}{\varepsilon},$$

где ρ — когерентная мера риска;

- линейный риск вклад, определяемый через набор аксиом, одна из которых — линейность по первому аргументу.

Дается представление обоих риск вкладов для когерентной меры MINV@R_N , определяемой как

$$\text{MINV@R}_N(X) = -E \min\{X_1, \dots, X_N\},$$

где $X_1, \dots, X_N$ — независимые копии X .

Также изучается асимптотическое поведение двух различных эмпирических оценок для меры риска MINV@R_N .

**Семинар проводится по средам в аудитории 16-24
с 16:45 до 17:45**

Координатором семинара на осенний семестр 2008 года назначен к.ф.-м.н. Андрей Валерьевич Селиванов (e-mail: selivanov.andrey@gmail.com), секретарем семинара — Айгуль Тилековна Абакирова (e-mail: abakirova@gmail.com).