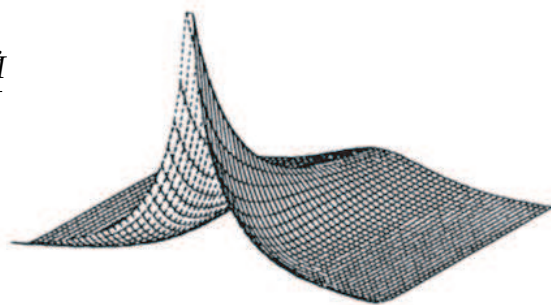




БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

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

15 сентября — предзащиты диссертаций аспирантов кафедры.

Ирхина Н. А. *Принцип Ванга в математической теории страхования*

Научный руководитель А. В. Лебедев.

В диссертации изучается принцип Ванга расчета премии в страховании. Получены достаточные условия его сводимости к среднеквадратическому принципу. Определены границы возможных значений премий и проведена максимизация чувствительности для различных семейств распределений рисков. Доказан ряд предельных теорем для премий, получены оценки скорости сходимости. Построена эмпирическая оценка премии Ванга и установлен ряд ее свойств. Изучена также экономия от совместного страхования независимых и зависимых рисков.

Коновалов Л. А. *Когерентные меры риска и предельный переход*

Научный руководитель А. Н. Ширяев.

Работа посвящена предельным соотношениям для когерентных мер риска. Будут рассмотрены теоремы о предельном переходе под знаком когерентной меры риска и некоторые их следствия, а также исследована связь между обычным и факторным риском для "большого" портфеля активов.

Морозов И. С. *Расширение класса допустимых стратегий в задаче максимизации робастной полезности*

Научный руководитель А. А. Гущин.

Мы рассматриваем задачу максимизации робастной полезности в абстрактной модели финансового рынка с конечной функцией полезности. В классических предположениях в качестве допустимых рассматривались только стратегии с ограниченными снизу капиталами. Мы расширяем класс допустимых стратегий, позволяя их капиталам быть не обязательно ограниченными снизу. Использование теории пространств Орлича по семейству мер позволяет поставить двойственную задачу и доказать ряд важных результатов (минимаксные соотношения и двойственные связи).

Яськов П. А. *Предельные теоремы для зависимых случайных полей*

Научный руководитель А. В. Булинский.

В докладе будет рассказано о различных вопросах, связанных с законами больших чисел (ЗБЧ), а также оценках, в них возникающих. В классической постановке будут продемонстрированы разные обобщения теоремы Меньшова-Радемахера, а неклассической – будут рассмотрены ЗБЧ для моделей эпидемий и дискретных стохастических интегралов. Будет также показано как оценки, участвующие при выводе ЗБЧ для дискретных интегралов, приводят к расширению теории интегрирования Янга в p -вариациях.

Семинар проводится по средам в аудитории 16-24

с 16:45 до 17:45

Координатором семинара на осенний семестр 2010 года назначен к.ф.-м.н., доцент кафедры теории вероятностей Алексей Викторович Лебедев (e-mail: avlebed@yandex.ru), ученым секретарем семинара - Айгуль Тилековна Абакирова (e-mail: abakirova@gmail.com).