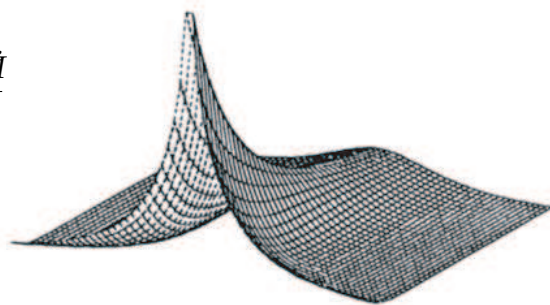




Кафедра ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

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

29 сентября — Генрих Пеникас (ГУ-ВШЭ)

Модели "копула": теоретические основы, практические приложения и открытые вопросы

Резюме.

Модели "копула" позволяют восстанавливать многомерные совместные распределения на основе информации о частных распределениях вероятностей случайных величин и характере их взаимосвязи. Выделяют несколько семейств копул (эллипсообразные, архимедовы, экстремальные и прочие) и три метода к их оценке и моделированию (параметрический, полупараметрический, непараметрический).

Свою область приложения модели "копула" находят в сферах, где предположение о многомерном нормальном или t-распределении не подтверждается и где применение единственно меры линейной корреляции представляется некорректным. Среди таких сфер особое место занимают задачи финансов. В частности, оценка рисков, оптимизация инвестиционного портфеля при ограничении на уровень риска, хеджирование рисков.

Несмотря на преимущества моделей "копула" перед подходами, основанными на многомерной нормальности распределения, существуют вопросы, требующие дополнительной проработки. К последним относятся вопросы анализа данных больших размерностей, выявления структурных сдвигов, решение проблемы "одного параметра" и способы выбора наилучшей модели.

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).