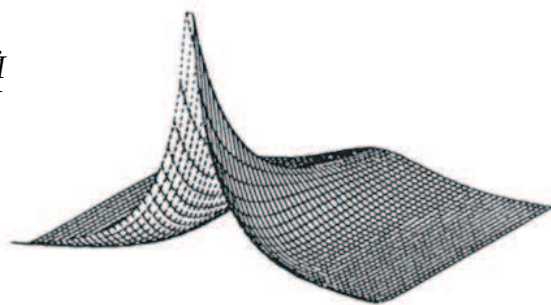




Кафедра ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

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

13 октября — Александр Александрович Гуцин (МИАН, МГУ)
Максимизация полезности: двойственная задача и связь с верхней ценой хеджирования платежных обязательств

Резюме.

В первой части доклада будет обсуждаться постановка задачи максимизации робастной полезности от терминального капитала и ее частных случаев. Основное внимание будет уделено рассмотрению двойственной задачи для общей статической модели рынка в случае, когда функция полезности конечна на полупрямой.

Во второй части доклада будет, в частности, обсуждаться вопрос о необходимых и достаточных условиях для того, чтобы в общей динамической модели рынка двойственную задачу можно было ставить в терминах супермартингалов плотностей или мер. Оказывается, этот вопрос тесно связан с тем, когда в этих же терминах выражается верхняя цена платежных обязательств.

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).