



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

9 марта — Д.О. Крамков (Университет Карнеги-Меллон, США)
2016 г.

Система квадратичных обратных стохастических дифференциальных уравнений, возникающая в модели с воздействием на цену

Будет рассматриваться финансовая модель, где цены рискованных активов котируются репрезентативным маркет-мейкером, который принимает во внимание внешний спрос. Мы опишем такие цены в терминах системы обратных стохастических дифференциальных уравнений с квадратичным ростом. Будет показано, что эта система допускает единственное решение для любого ограниченного спроса тогда и только тогда, когда неприятие риска маркет-мейкером достаточно мало. Доклад основан на совместной статье с Серджио Пулидо, см. arXiv: [1408.0916](https://arxiv.org/abs/1408.0916).

Семинар проводится по средам в аудитории 12-24 Главного Здания
Московского Государственного Университета им. М.В. Ломоносова
с 16:45 до 17:45

Координатором семинара на весенний семестр 2016 года назначена
профессор Яровая Елена Борисовна,
ученым секретарем семинара — А.И. Рытова