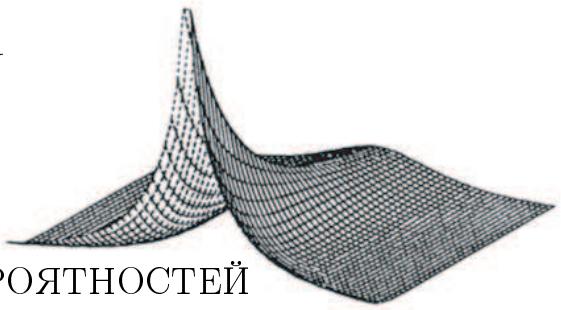




Кафедра ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ



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 рисковых 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 Сержио Пулидо, см. arXiv: [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

<http://new.math.msu.su/department/probab/seminar.html> — наши объявления в PDF