Math-Net.Ru

Общероссийский математический портал

Конференция “Стохастические и статистические аспекты финансовой математики и финансовой инженерии”, *Теория вероятн. и ее примен.*, 1996, том 41, выпуск 4, 952

DOI: <https://doi.org/10.4213/tvp3288>

Использование Общероссийского математического портала Math-Net.Ru подразумевает, что вы прочитали и согласны с пользовательским соглашением
<http://www.mathnet.ru/rus/agreement>

Параметры загрузки:

IP: 3.85.5.30

26 апреля 2023 г., 13:04:19

ИНФОРМАЦИЯ О НАУЧНОЙ ЖИЗНИ

24 и 25 сентября 1996 г. Отделение математики и Математический институт РАН, Московский государственный университет, Актуарно-финансовый центр и Российское общество актуариев провели конференцию «Математика и финансы».

Конференция проводилась в рамках цикла «Forum Mathématique Diderot», организуемого Европейским математическим обществом.

Параллельно в то же время конференции на эту тему проводились в Лондоне и Цюрихе.

Программа конференции

(в Москве)

«Стохастические и статистические аспекты финансовой математики и финансовой инженерии».

24 сентября.

1. Ширяев А. Н. Финансовая математика (4 часа):

I. Основные понятия, структуры, инструменты, цели и задачи. (Ключевые объекты, финансовые рынки; классические и неоклассические теории эволюций финансовых рынков).

II. Модели динамики финансового рынка ценных бумаг, обменных курсов, финансовых индексов. (Линейные и нелинейные модели. Гауссовские и условно гауссовские. Модели со свойствами автомодельности. Модели нелинейного динамического хаоса).

III. Статистический анализ финансовых индексов. (Эмпирические данные. Статистика одномерных распределений. Статистика волатильности, корреляционной зависимости, последствий).

IV. Финансовый рынок в условиях отсутствия арбитражных возможностей. (Две фундаментальные теоремы о «мартингальной» характеристике отсутствия арбитражных возможностей и полноте рынка).

2. Мельников А. В. Финансовые расчеты и инструменты в условиях полноты рынка (3 часа):

I. Опционы. Проблемы расчетов и хеджирования в опционах Европейского и Американского типов.

II. Форвардные и фьючерсные контракты. (Временная структура, оптимальный инвестиционный портфель).

III. Облигации. (Дюрационный анализ. Временная структура процентных ставок).

3. Schweizer M. (Berlin) On mean-variance hedging (1 час).

4. Круглый стол

25 сентября.

1. Крамков Д. О. Финансовые расчеты и инструменты в условиях неполноты рынка (3 часа):

I. Иллюстрация основных принципов оценивания и хеджирования платежных обязательств в неполных рынках для модели Блэка-Шоулса со случайной волатильностью.

II. Дуальная характеристика в неполных рынках. (Мартингальные меры, самофинансируемые стратегии как мартингалы, супермартингальная характеристика стратегий с потреблением.)

III. Общая методика «гарантированного» хеджирования в неполных рынках. Хеджирование как оптимальное инвестирование.

2. Дискуссия.