Math-Net.Ru

Общероссийский математический портал

Конференция и летняя школа “Стохастический анализ, мартингалы и финансовое моделирование”, *Теория вероятн. и ее примен.*, 2014, том 59, выпуск 2, 411–412

DOI: <https://doi.org/10.4213/tvp4574>

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: 18.209.158.208

26 апреля 2023 г., 16:44:35

© 2014 г.

ИНФОРМАЦИЯ О НАУЧНОЙ ЖИЗНИ

КОНФЕРЕНЦИЯ И ЛЕТНЯЯ ШКОЛА
«СТОХАСТИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ, МАРТИНГАЛЫ И ФИНАНСОВОЕ
МОДЕЛИРОВАНИЕ»

С 30 июня по 10 июля 2014 г. в городе Пушкин Ленинградской области проводились конференция и летняя школа «Стохастический анализ, мартингалы и финансовое моделирование».

Конференция проходила с 30 июня по 5 июля. Ее тематика была ориентирована на современные вопросы теории вероятностей, теории случайных процессов и математической статистики, а также их приложения в экономике и финансах. Темы докладов включали стохастические дифференциальные уравнения, стохастическое управление, оценивание и хеджирование производных финансовых инструментов, микроструктуру финансовых рынков, стохастические численные методы и др. В общей сложности было сделано 48 докладов, в том числе 18 ведущих докладов по 45 минут и 30 получасовых докладов. Докладчики представляли известные зарубежные и российские научные учреждения; 8 исследователей были из России, а остальные — из других стран. Ведущими докладчиками были F. Biagini, T. Meyer-Brandis (Мюнхенский университет), Д. Беломестный, М. Урусов, A. Winter (Университет Дуйсбурга и Эссена), F. Delbaen, M. Schweizer, J. Teichmann (Высшая техническая школа Цюриха), E. Eberlein (Университет Фрайбурга), H.-J. Engelbert (Университет Фридриха Шиллера в Йене), H. Föllmer (Университет Гумбольдта в Берлине), J. Kallsen (Университет Христиана Альбрехта в Киле), C. Kardaras, M. Zervos (Лондонская школа экономики), M. Kijima (Токийский столичный университет), Д. Крамков (Университет Карнеги–Меллон), Ю. Кутоянц (Университет Ле-Мана), S. Peng (Шандонгский университет), W. Runggaldier (Падуанский университет), П. Танков (Университет Париж VII).

С 3 по 10 июля была организована летняя школа для студентов и аспирантов российских учебных заведений. Целью проведения школы было познакомить молодых исследователей с современными методами и проблемами финансовой математики и стохастического анализа, в частности, заинтересовать студентов в выборе своей специализации по данным направлениям для обучения в аспирантуре. Для участия в летней школе из 100 поданных заявок было отобрано 25 слушателей. В рамках школы было прочитано 4 курса лекций: *Математика мер риска* (лектор — Freddy Delbaen), *Безарбитражная оценка активов, оптимизация инвестиций и равновесие* (Дмитрий Крамков), *Скачкообразные процессы в риск-менеджменте* (Петр Танков), *Теория арбитража для рынков с транзакционными издержками* (Юрий Кабанов). Все лекции читались на английском языке. Были также организованы семинарские занятия, которые проводили научные сотрудники Математического института РАН и Высшей школы экономики Александр Гушин, Алексей Муравлёв, Екатерина Паламарчук, Михаил Савостьянов.

Конференция и летняя школа были организованы на средства Международной лаборатории количественных финансов Высшей школы экономики, созданной в 2013 г. в рамках гранта Правительства РФ № 14.А12.31.0007. Поддержку в организации конференции также оказали Математический институт им. В. А. Стеклова РАН и инвестиционный фонд FM Investment Management (Великобритания). В оргкомитет кон-

ференции и летней школы вошли М. В. Житлухин, Ю. М. Кабанов, А. А. Муравлёв, Д. М. Хасиятуллина, А. Н. Ширяев, М. А. Савостьянов, А. С. Черкашина, Е. С. Паламарчук.

С материалами конференции можно ознакомиться на странице в Интернете <http://ilqf.hse.ru/confPushkin>, с материалами летней школы — на странице <http://ilqf.hse.ru/school>.

*А. Н. Ширяев, Ю. М. Кабанов,
М. В. Житлухин, А. А. Муравлёв*