



International Laboratory

SSP&QF

*Statistics of Stochastic Processes
and Quantitative Finance*

**Международная лаборатория статистики случайных процессов
и количественного финансового анализа**

Программа международной научной конференции

**«Робастная статистика и финансовая математика-2020»,
посвященной памяти
Виктора Васильевича Конева**

15 декабря - 16 декабря 2020 г.

Место проведения: онлайн конференция в Zoom

Programme of the International Scientific Conference
**“Robust Statistics and Financial Mathematics-2020”
dedicated to the memory of Victor Konev**

December 15th, 2020 – December 16th, 2020

Venue: online Zoom conference

Оргкомитет конференции:

- Пергаменщиков С.М., д.ф.-м.н., профессор, научный руководитель лаборатории – председатель оргкомитета, Томский государственный университет, Руанский университет;
- Пчелинцев Е.А., к.ф.-м.н., доцент, зав. лабораторией – заместитель председателя оргкомитета, Томский государственный университет;
- Васильев В.А., д.ф.-м.н., профессор, Томский государственный университет;
- Воробейчиков С.Э., д.ф.-м.н., профессор, Томский государственный университет;
- Дашян С., д.ф.-м.н., профессор, Университет Лилля, Франция;
- Кабанов Ю.М., д.ф.-м.н., профессор, Университет Франш-Конте, Франция;
- Курбацкий А.Н., к.ф.-м.н., доцент, Московский государственный университет;
- Кутоянц Ю.А., д.ф.-м.н., профессор, Университет Ле Мана, Франция;
- Чернояров О.В., д.ф.-м.н., доцент, Национальный исследовательский университет «МЭИ», г. Москва;
- Фурдринье Д., д.ф.-м.н., профессор, Руанский университет.

Доступ к онлайн конференции

Прямая ссылка:

<https://zoom.us/j/99475444894?pwd=RnIBbWZkcIAzekJKNKGhOSVlUGxMQT09>

Вход через код доступа

ID конференции: 994 7544 4894

Пароль: D55fP0

December 15th 2020, Tuesday
(Time is local, i.e. +4 h to Moscow time)

Chairman: Evgeny Pchelintsev

- 15.00-** Opening of the conference. Introductory speech
15.15 Professor V. Konev scientific way
Serguei M. Pergamenshchikov – Scientific Director of the International Laboratory SSP&QF Tomsk State University, Professor, University of Rouen
- 15.15-** Виктор Васильевич Конев: профессиональный путь
15.30 от студента до профессора
Александр Михайлович Горцев – д.ф.-м.н., профессор, Томский государственный университет
- 15.30-** Виктор Васильевич Конев: учитель и наставник
15.45 **Сергей Эрикович Воробейчиков** – д.ф.-м.н., профессор, Томский государственный университет
- 15.45-** Виктор Васильевич Конев: друг и коллега
16.00 **Leonid Galtchouk** – Professor, Strasbourg University
- 16.00-** On Delay Estimation and Testing for Stochastic Differential Equations
16.30 **Yury A. Kutoyants** – Professor, Le Mans University, Tomsk State University
- 16.30-** Задача разорения с инвестициями в рисковый актив
17.00 со стохастической волатильностью
Yury M. Kabanov – Professor, University of Franche-Comté, Moscow State University

17.00-17.30 On smooth change-point estimation for Poisson processes
Serguei Dachian – Professor, University of Lille, Tomsk State University

Arij Amiri – Ph.D. student, University of Lille

17.30-17.50 Estimating smoothness and optimal bandwidth for probability density functions

Vyacheslav A. Vasiliev – Professor, Tomsk State University

Dimitris N. Politis – Professor, University of California

Peter F. Tarassenko – Professor, Tomsk State University

17.50-18.10 Coffee break

Chairman: Serguei Egorov

18.10-18.30 О последовательном оценивании параметров авторегрессионной модели

Елена Леонидовна Хабарова – студент, Томский государственный университет

Татьяна Вениаминовна Емельянова – к.ф.-м.н., доцент, Томский государственный университет

18.30-19.00 Оценка современной стоимости m -летней пожизненной ренты с использованием информации о средней продолжительности жизни

Юрий Глебович Дмитриев – д.ф.-м.н., профессор, Томский государственный университет

Геннадий Михайлович Кошкин – д.ф.-м.н., профессор, Томский государственный университет

19.00-19.30 Методы оценивания для семимартингалльных регрессионных моделей больших данных

Evgeny A. Pchelintsev – Ph.D., Tomsk State University

19.30-20.00 Робастная оптимизация в задаче о портфеле

Алексей Дмитриевич Логунов – студент, Института механики, математики и компьютерных наук им. И.И. Воровича, Южный Федеральный Университет

20.00-20.30 Dynamics of the active mutual funds' performance

Алексей Николаевич Курбацкий – к.ф.-м.н., доцент, Московский государственный университет

December 16th 2020, Wednesday

Chairman: Evgeny Pchelintsev

15.00-15.30 Алгоритм приближённого оценивания параметра распределения непродлевающегося случайного мёртвого времени в рекуррентном обобщённом асинхронном потоке событий методом максимального правдоподобия

Людмила Алексеевна Нежелская – д.ф.-м.н., профессор, Томский государственный университет

Анна Александровна Першина – аспирант, Томский государственный университет

15.30-16.00 Критерий Крамера-Мизеса для семейства гамма-распределений

Геннадий Владимирович Мартынов – к.ф.-м.н., ст. науч. сотр., Институт проблем передачи информации РАН

16.00-16.30 Robust sequential estimation for high dimensional autoregressive models

Serguei M. Pergamenshchikov – Professor, Tomsk State University, University of Rouen

16.30-17.00 Adaptive optimal estimation with applications to parametric and non-parametric problems

Serguei E. Vorobeychikov – Professor, Tomsk State University

Vyacheslav A. Vasiliev – Professor, Tomsk State University

Dimitris N. Politis – Professor, University of California

17.00- Coffee break
17.20

Chairman: Serguei M. Pergamenshchikov

17.20- 17.50 Неасимптотическое доверительное оценивание параметров процесса авторегрессии с неизвестной дисперсией шума

Юлия Борисовна Буркатовская – к.ф.-м.н., доцент, Томский политехнический университет

Сергей Эрикович Воробейчиков – д.ф.-м.н., профессор, Томский государственный университет

17.50- 18.20 Эффективное оценивание в непараметрических регрессионных моделях с шумами Леви малой интенсивности

Мария Анатольевна Лещинская – аспирант, Томский государственный университет

18.20- 18.50 Численное сравнение процедур оценивания параметра процесса $AR(1)$ по зашумленным данным

Андрей Викторович Пупков – аспирант, Томский государственный университет

18.50- 19.20 Эффективное улучшенное оценивание тренда диффузионного процесса

Святослав Сергеевич Перелевский – мл. науч. сотр., Томский государственный университет

19.20- 19.50 Optimal investment and consumption for financial markets with jumps and transaction costs

Serguei Egorov – Ph.D. student, University of Rouen

Заключительное пленарное заседание

Chairman: Serguei M. Pergamenshchikov

20.00-20.15 Из воспоминаний о Викторе Васильевиче Коневе

Jordan M. Stoyanov - Professor, Institute of Mathematics and Informatics, Bulgarian Academy of Sciences

20.15-20.45 Круглый стол – дискуссии, обсуждения. Закрытие конференции