



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
ИССЛЕДОВАТЕЛЬСКИЙ
Томский
государственный
университет



NATIONAL
RESEARCH
Tomsk
State
University

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»

01 июля - 02 июля 2015 г.

Место проведения: 2 корпус ТГУ, 402 ауд.

Programme of the International Scientific Conference
“Robust Statistics and Financial Mathematics”

01 July 2015 – 02 July 2015

Venue: Tomsk State University, 2 building, Room 402

01 июля 2015, Среда

09.30-10.00	Регистрация участников
10.00-10.30	Открытие международной научной конференции Пергаменщиков Сергей Маркович – научный руководитель международной лаборатории ССПиКФА, д.ф.-м.н., профессор, Руанский университет
10.30-12.30	Стохастическое исчисление для процессов со скачками в предсказуемые моменты времени Гальчук Леонид Исакович – д.ф.-м.н., профессор, Страсбургский университет
12.30-13.00	Оптимизация портфеля на финансовом рынке с коррелированными доходностями с учетом ограничений, транзакционных издержек и при различных ставках займа и предоставления денег в долг Домбровский Владимир Валентинович – д.т.н., профессор, Томский государственный университет Объедко Татьяна Юрьевна – к.ф.-м.н., доцент, Томский государственный университет
13.00-14.00	Обед

14.00-14.30	<p>Модели страхования жизни и инвестиционных рисков</p> <p>Пергаменщиков Сергей Маркович – д.ф.-м.н., профессор, Руанский университет</p>
14.30-15.00	<p>Улучшенные взвешенные оценки МНК для негауссовской непрерывной модели регрессии</p> <p>Пчелинцев Евгений Анатольевич – зав. международной лаборатории ССПиКФА, к.ф.-м.н., доцент, Томский государственный университет</p> <p>Пчелинцев Валерий Анатольевич – к.ф.-м.н., доцент, Томский политехнический университет</p>
15.00-15.30	<p>О гарантированном последовательном обнаружении разладки в авторегрессионных процессах</p> <p>Буркатовская Юлия Борисовна – к.ф.-м.н., доцент, Томский политехнический университет</p> <p>Воробейчиков Сергей Эрикович – д.ф.-м.н., профессор, Томский государственный университет</p>
15.30-16.00	Кофе-брейк
16.00-16.30	<p>Метод усечённого оценивания при построении оптимальных прогнозов AP-процессов</p> <p>Кусаинов Марат Ислямбекович – аспирант, Томский государственный университет</p>

16.30-17.00	<p>О некоторых свойствах мартингалов с дискретным временем</p> <p>Анпилогова Ксения Андреевна – студент, Томский государственный университет</p> <p>Тугушев Наиль Равилевич – студент, Томский государственный университет</p>
17.00-17.30	<p>Теорема о представлении для квадратично интегрируемых мартингалов и ее применение к азиатским опционам</p> <p>Шишкова Алена Андреевна – студент, Томский государственный университет</p>
17.30-18.00	<p>Абрахам Вальд</p> <p>Разанова Валентина Владимировна – студент, Томский государственный университет</p>

02 июля 2015, Четверг

09.30-11.30	<p>Фильтрация ненаблюдаемых семимартингалов</p> <p>Гальчук Леонид Исакович – д.ф.-м.н., профессор, Страсбургский университет</p>
11.30-12.00	<p>Скорейшее обнаружение разладки в стохастической регрессии: непараметрический алгоритм CUSUM</p> <p>Конев Виктор Васильевич – д.ф.-м.н., профессор, Томский государственный университет</p>

12.00-12.30	<p>О последовательном оценивании параметров тригонометрического сигнала на фоне аддитивных зависимых шумов авторегрессионного типа</p> <p>Емельянова Татьяна Вениаминовна – ст. преп., Томский государственный университет</p>
12.30-13.00	<p>Усеченный метод оценивания с гарантированной точностью</p> <p>Васильев Вячеслав Артурович – д.ф.-м.н., профессор, Томский государственный университет</p>
13.00-14.00	Обед
14.00-14.30	<p>Оптимизация динамических инвестиционных портфелей при ограничениях на финансовом рынке с переключающимися режимами с использованием управления с прогнозирующей моделью</p> <p>Домбровский Владимир Валентинович – д.т.н., профессор, Томский государственный университет</p> <p>Объедко Татьяна Юрьевна – к.ф.-м.н., доцент, Томский государственный университет</p>
14.30-15.00	<p>Гарантированное оценивание параметров регрессии</p> <p>Догадова Татьяна Валерьевна – студент,</p>

	Томский государственный университет
15.00-15.30	<p>Усеченное оценивание параметров непрерывной авторегрессии</p> <p>Иванюк Юлия Васильевна – аспирант, Томский государственный университет</p>
15.30-16.00	Кофе-брейк
16.00-16.30	<p>Исследование эпистемологических установок студентов в кросс-культурном контексте</p> <p>Бондаренко Ирина Алексеевна – студент, Томский государственный университет</p>
16.30-17.00	<p>Подходы к исследованию качества регрессионных моделей</p> <p>Шайкина Анастасия Андреевна – студент, Томский государственный университет</p>
17.00-18.00	<p>Круглый стол – Перспективы развития лаборатории. Закрытие конференции</p> <p>Модератор – Пергаменщиков Сергей Маркович</p>

01 July 2015, Wednesday

09.30-10.00	Registration of Participants
10.00-10.30	<p>Opening of the International Scientific Conference</p> <p>Pergamenchchikov Serguei – Dr., Professor, University of Rouen</p>
10.30-12.30	<p>About Stochastic Calculus in Presence of Jumps at Predictable Stopping Times</p> <p>Galtchouk Leonid – Dr., Professor, University of Strasbourg</p>
12.30-13.00	<p>Portfolio Optimization in the Financial Market with Correlated Returns under Constraints, Transaction Costs and Different Rates for Borrowing and Lending</p> <p>Dombrovskii Vladimir – Head of the Department of Mathematical Methods and Information Technologies in Economics, Dr., Professor, Tomsk State University</p> <p>Ob'edko Tatyana – PhD, Associate Professor, Tomsk State University</p>
13.00-14.00	Lunch
14.00-14.30	<p>In the Life Insurance Business Risky Investments are Dangerous</p> <p>Pergamenchchikov Serguei – Dr., Professor, University of Rouen</p>

14.30-15.00	<p>Improved Weighted LS-estimates for a Continuous non-Gaussian Regression Model</p> <p>Pchelintsev Evgenii – PhD, Associate Professor, Tomsk State University</p> <p>Pchelintsev Valeriy – PhD, Associate Professor, Tomsk Polytechnic University</p>
15.00-15.30	<p>On Guaranteed Sequential Change Point Detection of Autoregressive Type Processes</p> <p>Burkatovskaya Yuliya – PhD, Associate Professor, Tomsk Polytechnic University</p> <p>Vorobeychikov Serguei – Dr., Professor, Tomsk State University</p>
15.30-16.00	Coffee break
16.00-16.30	<p>Truncated Estimation Method for Construction of the Optimal Forecasts in AR-Processes</p> <p>Kusainov Marat – Post-graduate Student, Tomsk State University</p>
16.30-17.00	<p>On Some Properties of Discrete-Time Martingales</p> <p>Anpilogova Kseniya – Student, Tomsk State University</p> <p>Tugushev Nail – Student, Tomsk State University</p>
17.00-17.30	<p>Representation Theorem for Squared Integrable Martingales and Its Applications to Asian</p>

	Options Shishkova Alyona – Student, Tomsk State University
17.30-18.00	Abraham Wald Razanova Valentina – Student, Tomsk State University

02 July 2015, Thursday

09.30-11.30	Filtering of Non-observable Semimartingales Galtchouk Leonid – Dr., Professor, University of Strasbourg
11.30-12.00	Quickest Change Point Detection in Stochastic Regression: Nonparametric Algorithm CUSUM Konev Victor – Dr., Professor, Tomsk State University
12.00-12.30	On the Sequential Parameters Estimation of a Trigonometric Signal in the Model with Additive Dependent Autoregressive Type Noises Emelyanova Tatyana – Assistant Professor, Tomsk State University
12.30-13.00	A Truncated Estimation Method with Guaranteed Accuracy Vasiliev Vyacheslav – Dr., Professor, Tomsk

	State University
13.00-14.00	Lunch
14.00-14.30	Dynamic Investment Portfolio Optimization under Constraints in the Financial Market with Regime Switching using Model Predictive Control Dombrovskii Vladimir – Dr., Professor, Tomsk State University Ob'edko Tatyana – PhD, Associate Professor, Tomsk State University
14.30-15.00	Guaranteed Estimation of Regression Parameters Dogadova Tatyana – Student, Tomsk State University
15.00-15.30	Truncated Parameters Estimation of Continuous Autoregression Ivanyuk Yuliya – Post-graduate Student, Tomsk State University
15.30-16.00	Coffee break
16.00-16.30	Research of Epistemological Beliefs of Students in a Cross-cultural Context Bondarenko Irina – Student, Tomsk State University

16.30-17.00	Approaches to the Study of the Quality of Regression Models Shaykina Anastasiya – Student, Tomsk State University
17.00-18.00	Round Table – Perspectives of Laboratory Development. Closing of the International Scientific Conference Moderator – Pergamenchchikov Serguei