

Программа
2-й Международной конференции по стохастическим методам
26 мая

10:00-10:15	Открытие конференции
10:15-10:50	Общее фотографирование (встреча у выхода на пирс)

Пленарные доклады
Председатель Шатских Сергей Яковлевич

10:50-11:30	Ширяев Альберт Николаевич, Файнберг Е.А. «О прямых и обратных уравнениях общих скачкообразных марковских процессов»
11:30-12:00	Кофейная пауза
12:00-12:40	Пиуновский Алексей Борисович «О стратегиях в управляемых скачкообразных марковских процессах»
12:40-13:20	Гущин Александр Александрович «Совместное распределение терминальных значений неотрицательного субмартингала и его компенсатора»
13:20-14:00	Гликлик Юрий Евгеньевич «Стохастические уравнения и включения с производными в среднем и их приложения»

Секционные доклады
Председатель: Насыров Фарит Сагитович

16:00-16:15	Дончев Дончо «Плотности выхода винеровского процесса через криволинейную границу»
16:20-16:35	Лисовский Дмитрий Игоревич «О распределении моментов первого выхода броуновского движения на случайную границу»
16:40-16:55	Рытова Анастасия Игоревна «Асимптотика моментов численностей частиц в ветвящемся случайном блуждании с тяжелыми хвостами»
17:00-17:15	Васильев Вячеслав Артурович, Догадова Т.В. «Адаптивное оптимальное прогнозирование многомерных диффузионных процессов»
17:20-17:35	Имомов Аъзам Абдурахимович «Об уточнении одной предельной теоремы из теории критических ветвящихся процессов с дискретным временем»
17:35-17:45	Кофейная пауза.

Председатель: Пресман Эрнст Львович

17:45-18:00	Печерский Евгений Абрамович «Марковская динамика конфигураций двух типов частиц»
18:05-18:20	Сластников Александр Дмитриевич, Аркин Вадим Иосифович «Пороговые стратегии в задаче оптимальной остановки диффузионных процессов Ито»
18:25-18:40	Бовкун Вадим Андреевич «О моделях, приводящих к бесконечномерной стохастической задаче Коши»

27 мая

Пленарные доклады
Председатель Гущин Александр Александрович

10:00-10:40	Рохлин Дмитрий Борисович «Центральная предельная теорема при наличии неопределенности и задача предсказания с использованием экспертных стратегий»
10:40-11:10	Насыров Фарит Сагитович «О представлении решений волновых уравнений в виде математических ожиданий»
11:10-11:40	Задорожний Владимир Григорьевич «О моментных функциях решений мультипликативно возмущенных случайным шумом дифференциальных уравнений»
11:40-12:10	Кофейная пауза.

Пленарные и секционные доклады
Председатель Задорожний Владимир Григорьевич

12:10-12:50	Малышев Вадим Александрович, Лыков Александр Андреевич «Насколько неравновесная статистическая физика статистична»
12:50-13:05	Турова Татьяна Сергеевна «Кулоновы системы в физике и биологии»

13:10-13:25	Замятин Андрей Андреевич, Ясногорский Р. «Регулярные квантовые и случайные блуждания»
Секционные доклады Председатель Ситник Сергей Михайлович	
16:00-16:15	Житлухин Михаил Валентинович «О новых неравенствах для максимума фрактального броуновского движения»
16:20-16:35	Бурнаев Евгений Владимирович, Голубев Г.Х. «Об одной задаче многоканального обнаружения сигнала»
16:40-16:55	Якимив Арсен Любомирович «О логарифме порядка случайной A-подстановки»
17:00-17:15	Пресман Эрнст Львович «Модель управления запасами с ценой, зависящей от марковского процесса с непрерывным временем и конечным числом состояний»
17:20-17:35	Асылгареев Артур Салаватович «Потраекторные теоремы сравнения для стохастических дифференциальных уравнений и их применения»
17:35-17:45	Кофейная пауза.
Председатель: Цветкова Инна Владимировна	
17:45-18:00	Ситник Сергей Михайлович «Неравенства типа Турана и их применения в вероятностных задачах»
18:05-18:20	Атласов Игорь Викторович «Параллельная работа двух устройств для случая, когда должно работать хотя бы одно из устройств»
18:25-18:40	Шишкина Элина Леонидовна «Дробное уравнение Эйлера-Пуассона-Дарбу и случайные блуждания»

28 мая

Доклады в СОСК «Радуга», пос. Дивноморское (отъезд из «Моряка» в 10:00)

Секционные доклады

Председатель: Шамраева Виктория Викторовна

12:15-12:30	Никитина Алла Валерьевна, Сухинов А.И., Сидорякина В.В. «Обоснование и моделирование коэффициента турбулентного обмена водоемов на основе стохастического метода»
12:35-12:50	Чистяков Александр Евгеньевич, Тимофеева Е.Ф. «Обработка натуральных экспериментов для определения параметров морских волн на основе стохастических подходов»
12:55-13:10	Переварюха Андрей Юрьевич «Моделирование деградации промысловой популяции в ситуации стохастической неопределенности»
13:15-13:30	Бескопыльный Алексей Николаевич, Бескопыльная Наталья Игоревна «Стохастические модели механических свойств металлов»
13:30-14:00	Обед

Пленарные и секционные доклады

Председатель Никитина Алла Валерьевна

15:00-15:30	Павлов Игорь Викторович «Интерполяционные мартингалльные меры и хааровские расширения финансовых рынков»
15:30-15:45	Шамраева Виктория Викторовна «О существовании специальных интерполяционных мартингалльных мер, допускающих преобразование неполных финансовых рынков в полные»
15:50-16:05	Цветкова Инна Владимировна «Программная реализация вычисления канонического хеджа для неполных рынков со счетным числом состояний»
16:10-16:25	Власков Григорий Андреевич, Можяев Александр Михайлович «Моделирование стохастически конвектирующей ионосферы»
16:30-16:45	Углич Сергей Илларионович «Об оптимизации квазилинейных систем с несколькими случайными приоритетами»

Отъезд из СОСК «Радуга» в «Моряк» в 17:30

29 мая

Пленарные доклады

Председатель: **Гликлик Юрий Евгеньевич**

10:00-10:30	Шатских Сергей Яковлевич, Мелкумова Л.Э. «Метод максимального правдоподобия в теореме де Финетти»
10:30-11:00	Кудрявцев Олег Евгеньевич «Численные методы оценки ликвидности в моделях, допускающих скачки»
11:00-11:30	Кофейная пауза.
11:30-12:10	Белопольская Яна Исаевна «Вероятностные представления решения задачи Коши для параболических систем с кросс-диффузией»
12:10-12:50	Смородина Наталия Васильевна «Представление решений начально-краевых задач средними значениями функционалов от отражающихся от границы процессов»
Секционные доклады Председатель: Кудрявцев Олег Евгеньевич	
16:00-16:15	Муромская Анастасия Андреевна «Оптимальное перестрахование для компании, заключающей договоры комбинированного страхования»
16:20-16:35	Родченко Василий Владимирович, Кудрявцев О.Е. «Вычисление стоимости барьерного опциона в моделях со стохастической волатильностью, допускающих скачки, с использованием быстрой факторизации Винера-Хопфа»
16:40-16:55	Пересецкий Анатолий Абрамович, Живайкина А.Д. «Кредитные рейтинги российских банков и отзывы банковских лицензий 2012-2016»
16:55-17:05	Кофейная пауза.
Председатель: Родченко Василий Владимирович	
17:05-17:20	Мартынов Геннадий Владимирович «Критерий согласия для гипотезы о гауссовости случайного процесса»
17:25-17:40	Ширяева Людмила Константиновна «О свойствах трехпараметрической копула-функции Граббса»
17:45-18:00	Пчелинцев Евгений Анатольевич «Адаптивное оценивание в непрерывной регрессии с условно-гауссовскими шумами Леви»
18:05-18:20	Мелкумова Лана Эдуардовна «Сравнение результатов регрессионного анализа для методов НК, Ridge и LASSO»
18:25-18:40	Калимулина Эльмира Юрьевна «Оценка скорости сходимости к стационарному распределению ненадежной сети Джексона с динамической маршрутизацией»

30 мая

Секционные доклады

Председатель **Мелкумова Лана Эдуардовна**

10:00-10:15	Данекянц Анжелика Генриковна, Волосатова Татьяна Анатольевна «Моделирование квазилинейных сложных систем: случай трех приоритетов вероятностного характера с единичной суммой»
10:20-10:35	Красий Надежда Павловна «Оптимизация квазилинейных моделей с несколькими независимыми приоритетами»
10:40-10:55	Богачева Марина Николаевна, Зеленцов Леонид Борисович «Прогнозирование состояния инвестиционно-строительных проектов на основе стохастического моделирования»
11:00-11:15	Трепачева Алина Викторовна «О случайных отображениях над кольцом вычетов по модулю труднофакторизуемого числа, реализуемых полиномами»
11:20-11:35	Буртыка Филипп Борисович «К вопросу о конфиденциальности раскрытия количества подходящих записей в протоколе неагрегированного запроса к зашифрованной базе данных»
11:40-11:55	Сахарова Людмила Викторовна, Стрюков М.Б. «Оптимизационная модель агротехнического землепользования в условиях минимизации рисков урожайности»
12:00-12:15	Жураев Даврон Аслонкулович «Задача Коши для матричных факторизаций уравнения Гельмгольца в неограниченной области»
14:00-15:00	Заккрытие конференции (в столовой во время обеда)