

MEGHÍVÓ

A BJMT 2014. évi DÍJAINAK ÁTADÁSÁRA

A BJMT 2014. évi díjainak átadására

december 17-én (szerdán) 14.00 órai kezdettel kerül sor az MTA **Rényi Alfréd Matematikai Kutatóintézet Nagytermében** (Budapest V. kerület, Reáltanoda utca 13-15., I. emelet).

A díjkiosztáson átadjuk a

- Szele Tibor Emlékérmét,
- Grünwald Géza Emlékérmeket,
- Farkas Gyula Emlékdíjakat,
- Rényi Kató Emlékdíjakat,
- Patai Alapítvány díját,
- Schweitzer Miklós Emlékverseny díjait,
- Kürschák József Matematikai Tanulóverseny díjait.

Az ünnepi ülés keretében Barczy Mátyás „Paraméterbecslés két-faktoros affin diffúziós modellek esetén” címmel tart előadást.

Az előadás rövid kivonata:

Az affin folyamatok a folytonos idejű, folytonos állapotterű bevándorlásos elágazó folyamatok és az Ornstein-Uhlenbeck típusú folyamatok közös általánosításai. A valós adatsorokra való jól-illeszthetőségüknek köszönhetően a pénzügyi matematikában egyre népszerűbbek, motiválva ezzel statisztikai vizsgálatainkat is. Az előadásban ún. két-faktoros affin diffúziós modellek (pl. a Heston-modell) bizonyos paramétereire maximum likelihood, illetve feltételes legkisebb négyzetes becslésének aszimptotikus viselkedésével fogunk foglalkozni. A folyamat várható értékének aszimptotikus viselkedését felhasználva, megadunk egy osztályozását, megkülönböztetve szubkritikus, kritikus és szuperkritikus folyamatokat.

A szubkritikus esetben a statisztikai vizsgálatok előkészületeként először megvizsgáljuk az egyértelmű stacionárius eloszlás létezésének és az ergodicitásnak a kérdését; a kritikus eset tárgyalásához pedig először egy alkalmas skálázási tételt származtatunk. A szubkritikus esetben a vizsgált statisztikák határeloszlása aszimptotikusan normális, szemben a kritikus és szuperkritikus esetekkel.