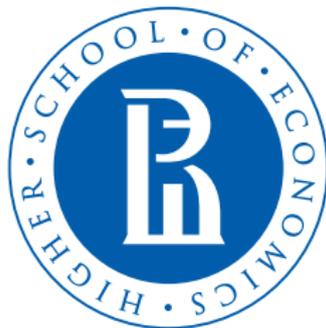


Презентация магистерской программы
“Статистическое моделирование и
актуарные расчёты”
 (“Statistical modelling and actuarial science”)



NATIONAL RESEARCH
UNIVERSITY

- применение современных статистических и вероятностных методов к задачам, возникающих в различных сферах человеческой деятельности.

Секции на конференции по статистическому моделированию в г. Гронинген (Голландия), июнь 2017 г.:

Statistical ecology, Statistical linguistics,
Statistical methods in climate research, Statistical demographics,
Statistical econometrics, Psychometrics and chemometrics,
Statistical bioinformatics, Biostatistics, ...

Современные методы:

Spatial statistics, Smoothing and non-parametric inference,
Bayesian modelling, Hidden Markov chains,
Variable selection, Model misspecification, Bootstrap,
Neural networks, Wavelet regression, Generalized linear models,...

Комплекс актуарных задач:

- ▶ моделирование страхового бизнеса;
- ▶ расчёт страховых тарифов и страховых резервов;
- ▶ оценка прибыльности и эффективности страховой компании;
- ▶ анализ рисков, риск-менеджмент;
- ▶ автоматизация и оптимизация процессов и расчетов.

Востребованность на рынке труда: открытые вакансии в

- ▶ страховых компаниях,
- ▶ пенсионных фондах,
- ▶ компаниях, оказывающих аудиторские и консалтинговые услуги (компании Большой Четверки - PWC, Deloitte, Ernst & Young, KPMG).

Авторитетный портал CareerCast.com ежегодно на протяжении 25 лет публикуется рейтинг 200 профессий по данным Бюро статистики труда и других организаций США.

Критерии оценки:

рабочая обстановка, доход, условия труда и уровень стресса.

2019 год:

- 1 data scientist;
- 2 статистик;
- 8 математик;
- 9 operations research analyst;
- 10 актуарий.

1. Вероятностные методы моделирования и анализа экономических процессов:

ТВ и МС → Случайные процессы и моделирование → Оценивание и прогнозирование в частично наблюдаемых стохастических моделях, Моделирование скачкообразных процессов в экономике, Методы популяционной динамики, Элементы стохастического анализа, Вычислительные методы стохастики, ...

2. Методы современной статистики:

Многомерный анализ и непараметрическая статистика → Data Mining (современные технологии обработки стат. данных), Байесовская теория и анализ данных, ...

3. Основы теории страхования:

Мат. методы страхования → Актуарные расчёты в страховании жизни (life insurance) и другие разделы страхования (non-life insurance) → Риск-менеджмент, Актуарная статистика, ...

4. Экономические дисциплины:

Микроэкономика, Макроэкономика → Эконометрика, ...

isa.hse.ru

Национальный исследовательский университет «Высшая школа экономики» → Научные подразделения → Международная лаборатория стохастического анализа и его приложений

Международная лаборатория стохастического анализа и его приложений

О лаборатории

В феврале-марте 2014 в НИУ ВШЭ в результате конкурса трехлетних проектов была создана Лаборатория стохастического анализа и его приложений. Заведующий лабораторией профессор, доктор ф.-м. наук Валентин Дмитриевич Конаков. Лаборатория собрала вместе исследователей из разных стран (Германии, Франции, России, Великобритании), из разных университетов, но с близкими исследовательскими интересами. В состав лаборатории входит инициативная группа из ВШЭ (В. Конаков и В. Панов), а также известные во всем мире приглашенные профессора (S. Molchanov, S. Menozzi, D. Belomestny, A. Veretennikov, E. Mammen). Данная лаборатория создана на базе успешной многолетней совместной исследовательской работы: Konaakov – Menozzi, Belomestny – Panov, Konaakov – Mammen, результаты которой отражены в публикациях в ведущих международных научных журналах: "Journal of Theoretical Probability", "Probability Theory and Related Fields", "Bernoulli", "Stochastic Processes and Their Applications". Некоторые совместные публикации доступны по ссылке.

ПУБЛИКАЦИИ

Книга

[Некоторые главы анализа и приложения к финансовой математике \(2е изд.\)](#)

Веретенникова Е. В., Веретенников А. Ю.
М.: Прометей, 2016.

Статья

[The Minimum Increment of f-Divergences Given Total Variation Distances](#)

A.A.Gushchin.
Mathematical Methods of Statistics. 2016. Vol. 25.

О лаборатории
 Сотрудники
 Научная деятельность
 Образовательная деятельность
 Публикации
 Конференции и семинары
 Мини-курсы
 Новости
 Анонсы
 Заведующий лабораторией: Конаков Валентин Дмитриевич

Международная лаборатория стохастического анализа и его приложений:

- 4 профессора НИУ ВШЭ:

В.Д.Конаков, А.А.Гущин, А.В.Колесников, М.Я.Кельберт.

- 3 Ph.D.: В.А.Панов (Берлин), М.А.Веретенникова (Уорик, Англия),
Г.Морено-Франко (СИМАТ, Мексика).

- 4 приглашённых профессора зарубежных университетов:

С.А.Молчанов (Шарлотт, США),

А.Ю.Веретенников (Лидс, Англия),

С.Меноззи (Эври, Франция),

В.Н.Колокольцов (Уорик, Англия).

Приглашённые лекторы (2014-2019):

Э. Маммен (Гейдельберг, Германия), М. Грабчак (Шарлотта, США),

Э. Орсингер (Рим, Италия), П.Девельс (Париж, Франция),

Й.Стоянов (Ньюкасл, Англия), А.Когатсу-Хига (Кусацу, Япония),

О.Клопп (Париж, Франция), М.Подольский (Орхус, Дания)

Программа двойных дипломов с ENSAE

(Ecole Nationale de la Statistique et de l'Administrations Economique) -
ведущий университет Франции по направлению стохастического анализа.

Конаков Валентин Дмитриевич <VKonakov@hse.ru>

академический руководитель программы, профессор ФЭН, заведующий международной лабораторией стохастического анализа и его приложений

Панов Владимир Александрович <VPanov@hse.ru>

разработчик программы, Ph.D. - доцент ФЭН

Ермольчик Надежда Юрьевна <NErmolchik@hse.ru>

менеджер магистерских программ ФЭН