



Факультет компьютерных наук ВШЭ

Лаборатория структурных методов анализа данных
в предсказательном моделировании МФТИ

Московский физико-технический институт
(Государственный университет)

Лаборатория стохастического анализа и его приложений ВШЭ

26-27 февраля

26.02.2015

- 09:50 – 10:00** Opening
- 10:00 – 11:00** **Michael Neumann:** Bootstrap for degenerate U- and V-statistics
- 11:00 – 11:30** Break
- 11:30 – 12:00** **Mayya Zhilova:** Simultaneous likelihood-based bootstrap confidence sets for misspecified models
- 12:00 – 12:30** **Andzhey Kozuk:** Linear hypothesis testing in the problem with weak instrumental variables
- 12:30 – 13:00** **Egor Klochkov/Denis Belomesty:** Spectral estimation for sparse multi-dimensional Lévy processes
- 13:00 – 13:30** **Karl Gregori:** A Smooth Block Bootstrap for Statistical Functionals and Time Series
- 13:30 – 15:00** Lunch
- 15:00 – 15:30** **Roland Hildebrand:** Rank 1 generated spectrahedral cones
- 15:30 – 16:00** **Stefan Richter:** Cross validation for linear locally stationary processes
- 16:00 – 16:30** **Maxim Panov:** High-dimensional Bernstein - von Mises phenomenon
- 16:30 – 17:00** Break
- 17:00 – 17:30** **Yuri Maximov:** Fast rates for multi-class classification
- 17:30 – 18:00** **Alexandra Suvorikova/ Nasar Buzun:** Multi-scale change point detection

Место проведения:

НИУ ВШЭ на Шаболовке
(ул. Шаболовка, д. 26, корпус 3, ауд. 3211).

Для преподавателей, сотрудников и студентов НИУ ВШЭ вход свободный. Для гостей необходима предварительная запись по e-mail: erichkova@hse.ru

Магистерская программа
«Математические методы
оптимизации и стохастики»
Высшей школы экономики
<http://www.hse.ru/ma/mmos/>

Workshop

Frontiers of High Dimensional Statistics, Optimization, and Econometrics

27.02.2015

- 10:00 – 10:45** **Yuriy Nesterov:** Complexity bounds for primal-dual methods minimizing the model of objective function
- 10:45 – 11:30** **Boris Polyak:** Quadratic transformations: convexity vs nonconvexity
- 11:30 – 12:00** Break
- 12:00 – 12:30** **Alexander Gasnikov/Ekaterina Krymova:** Stochastic online gradient-free methods with inexact oracle (convex case vs strictly convex case; one point oracle vs two point oracle)
- 12:30 – 13:00** **Pavel Dvurechenski:** Random gradient-free methods for random walk based web page ranking functions learning
- 13:00 – 14:30** Lunch
- 14:30 – 15:00** **Evgeny Burnaev:** Efficiency of regression conformalization
- 15:00 – 15:30** **Anna Kozhina:** Stability of Ito diffusions transition densities with respect to coefficient perturbations
- 15:30 – 16:00** **Vladimir Panov:** Statistical inference for generalized Ornstein - Uhlenbeck processes
- 16:00 – 16:30** Break
- 16:30 – 17:00** **Yuri Dorn:** First order methods for transportation problems. Complexity analysis
- 17:00 – 17:30** **Kirill Efimov:** Smallest accepted method for subset selection
- 17:30 – 18:00** **Egor Klochkov:** Semi-parametric estimation in errors-in-variables regression

Все доклады будут представлены на английском языке.