

NORMEX, НОВЫЙ МЕТОД ОЦЕНКИ РАСПРЕДЕЛЕНИЯ ОБЪЕДИНЕННЫХ РИСКОВ С ТЯЖЕЛЫМИ ХВОСТАМИ.

Мы обсудим относительно новый метод аппроксимации суммы независимых распределенных случайных величин с толстыми хвостами. Метод обеспечивает более быструю скорость сходимости, чем стандартная центральная предельная теорема. Для более качественного понимания метода мы поговорим о двух существенно разных классах распределений: с толстыми и тонкими хвостами. В качестве приложения метода мы рассмотрим оценку меры риска годовой доходности финансовых активов.