

## Curriculum Vitae

ხეჩინაშვილი ზაზა

დაბადების თარიღი: 5 მარტი 1970.

### საკონტაქტო მისამართი

უნივერსიტეტის ქუჩა 2, 0143, თბილისი, საქართველო.

ე-მეილი: khechinashvili@gmail.com

ტელ: 555183733.

### განათლება

ივანე ჯავახიშვილის სახელობის თბილისის სახელმწიფო უნივერსიტეტი, მექანიკა-მათემატიკის ფაკულტეტი 1987-1992, დიპლომი N. U 000007.

თბილისის სახელმწიფო უნივერსიტეტის ასპირანტურა, ალბათობის თეორიისა და მათემატიკური სტატისტიკის მიმართულება 1992-1995.

### სამეცნიერო ხარისხი

ფიზიკა-მათემატიკის მეცნიერებათა კანდიდატი, 1999, დიპლომი N. 002546.

### კვლევის ინტერესები

სტოქასტური ანალიზი, შემთხვევითი პროცესების თეორია, სტატისტიკა, ფინანსური მათემატიკა.

### სამუშაო გამოცდილება

თბილისის სახელმწიფო უნივერსიტეტის ალბათურ-სტატისტიკური მეთოდების ლაბორატორიის მეცნიერ-თანამშრომელი, 1997-2006.

თბილისის სახელმწიფო უნივერსიტეტის მოწვეული ლექტორი 2000-2009.

თბილისის სახელმწიფო უნივერსიტეტის ასისტენტ-პროფესორი 2009-წლიდან.

### სამეცნიერო ვიზიტები საზღვარგარეთ

1. ფრიდრიხ-შილერის სახელობის იენას უნივერსიტეტი (გერმანია), მათემატიკის და ინფორმატიკის ფაკულტეტი, სტოქასტიკის ინსტიტუტი, იენისი-ივლისი, 2001.

2. საერთაშორისო კონფერენცია ინფორმაციის თეორიასა და კომპიუტერულ მეცნიერებებში, ერევანი, 17-21 სექტემბერი, 2001.

3. მათემატიკოსთა საერთაშორისო კონგრესი, პეკინი (ჩინეთი), აგვისტო 20-28, 2002.

4. კოპენჰაგენის უნივერსიტეტი (დანია), მათემატიკის დეპარტამენტი. 11-29 მაისი, 2003.
5. იუვასკილას უნივერსიტეტი (ფინეთი), მათემატიკისა და მეცნიერებების ფაკულტეტი, 2005.
6. მეორე საერთაშორისო კონფერენცია „კიბერნეტიკის და ინფორმატიკის პრობლემები“, ბაქო (აზერბაიჯანი), 10-12 სექტემბერი, 2008.
7. საერთაშორისო კონფერენცია “ალბათობა, საიმედოობა და სტოქასტური ოპტიმიზაცია” (PRESTO 2015). კიევი (უკრაინა), 7-10 აპრილი, 2015.
8. საერთაშორისო კონფერენცია ფუნქციონალურ ანალიზში მიძღვნილი სტეფან ბანახის დაბადების 125 წლისთავისადმი. ლვოვი, უკრაინა, 18-23 სექტემბერი, 2017.

### პროექტები და გრანტები

1. ფონდი ევრაზია, პროექტი "საკონსულტაციო სერვისის საქართველოს ფინანსური და სადაზღვევო სტრუქტურებისათვის". გრანტი N. C 96-0030. 1997.
2. INTAS-ის სტიპენდია-გრანტი ახალგაზრდა მეცნიერებისათვის. 2000-2001.
3. INTAS-ის პროექტი "წყაროს ეფექტური კოდირება და დაკავშირებული პრობლემები". გრანტი N. 00-738. 2000-2003.
4. ფინანსური ბაზარი დარღვევით მათემატიკური მოდელები. ენტროპია მინიმალური მარტინგალური ზომები. პროგნოზირება. საქართველოს ეროვნული სამეცნიერო ფონდი (GNSF), გრანტი N.303/07, 045, 2007-2008.

### უცხო ენები

ინგლისური, რუსული.

### ძირითადი პუბლიკაციები

- [1] Khechinashvili Z. *Financial (B, S) -Market With Gaussian Martingale. Mean Square Optimal Hedging Strategies*. Proceedings of A. Razmadze Mathematical Institute. Vol. 115, 33-43, 1997. With O. Glonti
- [2] Khechinashvili Z. *Mean square optimal hedging strategies for Currency Option*. Bulletin of the Georgian Academy of Sciences. V.160, N.2, p.197-198, 1999.
- [3] Khechinashvili Z. *Mean Square Optimal Hedging Strategies for (B,S) Financial Market*. Bulletin of the Georgian Academy of Sciences. V.159, N.2, p.185-188, 1999.
- [4] Khechinashvili Z. *The Minimal Entropy and Minimal  $\phi$ -Divergence Distance Martingale Measures for the Trinomial Scheme* AMI, Vol. 7, No.2, 28-40, 2002. With Glonti O., Jamburia L.
- [5] Khechinashvili Z. *The minimal  $\phi$ -divergence distance martingale measures for the trinomial scheme*. Bulletin of the Georgian Academy of Sciences. N. 166/3, 2003. With Glonti O., Jamburia L.
- [6] Khechinashvili Z. *The Minimal Entropy Martingale Measure in Trinomial Scheme with "Disorder"*. Bulletin of the Georgian Academy of Sciences, V.170, N.3, 2004. With Glonti O., Jamburia L.

- [7] Khechinashvili Z. *Trinomial scheme with "disorder". The minimal entropy martingale measure*. Applied Mathematics, Informatics and Mechanics. V. 9, N. 2, 14-29, 2004. With Glonti O., Jamburia L.
- [8] Khechinashvili Z. *The Nash Equilibrium in a Game of Calibration*. Probability Theory and Applications. Vol. 51, N3, 537-551, 2006. With O.Glonti, P.Harremous, F.Topsoe.
- [9] Khechinashvili Z. *Martingale measures for the geometrical gaussian martingale*. Bulletin of the Georgian Academy of Sciences. Vol. 2, N. 4, 2008, pp. 40-43. With O.Glonti.
- [10] Khechinashvili Z. *Martingale measure for the geometrical gaussian martingale*. The Second International Conference "Problems of Cybernetics and Informatics", September 10-12, pp. 251-252, 2008, Baku, Azerbaijan. With O.Glonti.
- [11] Khechinashvili Z. *Martingale measure for the geometrical gaussian martingales with "disorder"*. Proceedings of I.Vekua Institute of Applied Mathematics. Vol. 58, 2008, pp. 102-109. With O.Glonti.
- [12] Khechinashvili Z. *Financial markets with disorders*. Reports of Enlarged Sessions of the Seminar of I. Vekua Institute of Applied Mathematics. 2009. With O. Glonti, L. Jamburia.
- [13] Khechinashvili Z. *On the measures generated by the solutions of ordinal differential equations of high order and random right side*. Natural sciences and Modernity: Materials of I Russian scientific-practical conference. Moscow, Publishing House НИИРПП, Vol.1, pp.92-99.
- [14] Khechinashvili Z. *Geometric Gaussian martingale with disorder*. Theory of Stochastic Processes. Vol.16 (32) No.1 (2010), 44-48. With O. Glonti.
- [15] Khechinashvili Z. *On inversion of the integral with conditional Wiener measure*. Georgian International Journal of Science and Technology. Vol. 3, No. 2, 2010, p.53-59. With Sokhadze G.
- [16] Khechinashvili Z. *On one statistical problem in the Hilbert space*. Proceeding of I. Vekua Institute of Applied math, vol. 61-62, 2012. p. 55-64. With E. Nadaraya, G.Sokhadze, A. Tkeshelashvili .
- [17] Khechinashvili Z. *On the second boundary problem of ordinal differential equation with random coefficients*. Georgian International Journal of Science and Technology. Vol. 5, Issue 1-2. 2013, p. 1-6. With A. Gubeladze, G.Sokhadze.
- [18] Khechinashvili Z. *The Equivalence of Distributions of Solutions of Linear Equations with Random Perturbation*. Georgian International Journal of Science and Technology. Vol. 5, No. 1-2, 2013. p. With P. Babilua, G.Sokhadze.
- [19] *On Transformations of a Random Measure*. Applied Mathematics, Informatics and Mechanics. Jaoshvili V., Khechinashvili Z., Sokhadze G., Tkeshelashvili A. Vol. 18, No.1, 2013, p. 47-54.
- [20] Khechinashvili Z. *On maximum likelihood estimation of parameters of Ornstein-Uhlenbeck processes*. Applied Mathematics, Informatics and Mechanics. Vol. 19, No. 1, pp. 3-8, 2014.
- [21] *On Estimation Unbounded Functionals of Probability Distribution Density*. Reports of Enlarged Session of the Seminar of I. Vekua Institute of Applied Mathematics. Vol. 28, 2014, pp. 9-11. With Buadze T., Sokhadze G.
- [22] Khechinashvili Z. *ON THE FERNIQUE-SKOROKHOD TYPE INTEGRALE*. Reports of Enlarged Session of the Seminar of I. Vekua Institute of Applied Mathematics, Volume 29, 2015. With Buadze T., Sokhadze G.
- [23] Khechinashvili Z. *On one discrete model of the financial market*. Bulletin of the Georgian Academy of Sciences. Vol. 4, 2016.

- [24] Khechinashvili Z. On the Estimation of the Odds-Ratio Based on Kernel Estimates of the Regression Function. Bulletin of the Georgian National Academy of Sciences. Vol. 11, No. 3, 2017. With E. Nadaraya, M. Patsatsia, P. Babilua.
- [25] Khechinashvili Z. On the multidimensional financial (B,S)-market. Reports of Enlarged Session of the Seminar of I. Vekua Institute of Applied Mathematics. Vol. 31, 2017. With B. Dochviri, N. Bokhashvili.