

数学与系统科学研究院

计算数学所学术报告

报告人: 赵卫东 教授

(山东大学)

报告题目:

**High order schemes for forward
backward SDEs**

邀请人: 周涛 博士

报告时间: 2013 年 12 月 5 日 (周四)

下午 14:30-15:30

报告地点: 科技综合楼三层 301

计算数学所小报告厅

摘要:

我们首先简要介绍正倒向随机微分方程的背景和理论。然后讨论相关数值方法，专注于高阶方法的构造及分析。最后我们简要介绍这一研究领域的可能的研究课题和应用。

欢迎大家参加!