

数学与系统科学研究院
计算数学所网络学术报告

报告人： 柳振鑫 教授

(大连理工大学)

报告题目：

随机微分方程与Markov过程

邀请人： 洪佳林 研究员

报告时间： 2020 年 8 月 22 日 (周六)

晚上 19:00-21:00

报告工具： 腾讯会议 (ID: 699 732 718)

摘要:

在这篇报告中我们主要介绍 Ito 的随机微分方程理论，并说明随机微分方程的解是 Markov 过程，也是扩散过程。

欢迎大家参加!