

# 数学与系统科学研究院

## 计算数学所学术报告

报告人: 王鹏 教授

( 北京航空航天大学 )

报告题目:

不确定量化中的 PDF/CDF 方法

邀请人: 周涛 博士

报告时间: 2015 年 6 月 26 日 (周五)

上午 11:10~12:00

报告地点: 数学院南楼二层

204 会议室

## 摘要:

不确定性在自然世界和人工系统中广泛存在，其量化研究为基础科学、工程技术以及社会科学的诸多实际问题提供了有效的解决方向。伴随着计算机运算能力和数据取样技术的飞跃发展，近年来不确定性量化已成为重要的前沿交叉学科。我们近期提出的PDF/CDF方法为计算系统状态的全部统计信息，即概率密度 (PDF) 和概率分布 (CDF) 提供了新的框架，同时也有效解决了当前主要方法在介观尺度随机变量上的研究瓶颈。此次报告将通过两种常用方程介绍PDF/CDF方法：郎之万 (Langevin) 动力方程和一阶双曲方程

# 欢迎大家参加！