

数学与系统科学研究院

计算数学所学术报告

报告人: 刘智慧 博士

(南方科技大学)

报告题目:

**L^p -Convergence Rate of
Backward Euler Scheme for
Monotone SDEs**

邀请人: 洪佳林 研究员

报告时间: 2020 年 12 月 30 日 (周三)

晚上 19:00-20:00

报告地点: 数学院南楼

204 教室

摘要:

We derive the strong convergence rate of the backward Euler scheme for monotone SDEs in $L^p(\Omega)$ -norm with general $p \geq 2$. The results can be applied to SODEs with polynomial or exponential growth coefficients and SPDEs with polynomial growth coefficients.

欢迎大家参加!