

数学与系统科学研究院  
计算数学所网络学术报告

报告人: 吴黎明 教授

( 哈尔滨工业大学 )

报告题目:

超线性增长系数随机微分方程  
的数值解

邀请人: 洪佳林 研究员

报告时间: 2021 年 10 月 8 日 (周五)

下午 16:00-17:00

报告工具: 腾讯会议 400 216 487

## 摘要:

对于系数超线性增长的随机微分方程，经典算法如 **Euler-Maruyama** 不收敛。我将介绍一种生成算子逼近算法，用带跳随机过程去逼近。这个报告基于和成灵妍，李瑞因的合作工作。

# 欢迎大家参加！