

臺大數學系·臺大數學科學中心

國家理論科學研究中心數學組

PROBABILITY/APPLICATIONS MINI-COURSE

演講者：Alex Novikov 教授（UT Sydney, Australia）

講題：SDE and Finance based on Levy Processes

時間： 2006 年 11 月 29 日（星期三）10:20~12:10
2006 年 12 月 04 日（星期一）1:20~3:10

摘要

1. Some optimal stopping problems for Levy processes.
 2. Pricing of options under stochastic interest rate and dividend yield framework.
 3. First passage problems for Levy-driven Ornstein-Uhlenbeck processes.
 4. Perspectives
-

地點：臺灣大學新數學館 308 室

* * * 歡迎參加 敬請公告 * * *