



新加坡南洋理工大学数学学院Nicolas Privault教授做客精算论坛

[发表时间]: 2012-01-03 [来源]: 中国精算研究院 [浏览次数]:

12月28日上午,新加坡南洋理工大学数学学院Nicolas Privault教授做客我校精算研究院精算论坛,在学术会堂702报告厅做了一场题为“Stochastic Calculus for Jump Processes -- Pricing and hedging in Jump Models”的报告,讲座由精算研究院韦晓副教授主持。精算研究院的师生参加了本次报告。

Privault 教授是法国的终身教授,先后曾在法国的拉罗谢尔大学(Universite de La Rochelle),普瓦捷大学(Universite de Poitier),香港城市大学任教。主要从事随机分析理论和金融应用方面的研究,在《Mathematical Finance》,《Finance & Stochastics》,《Insurance: Mathematics and Economics》,《Bernoulli》,《SIAM Journal on Mathematical Analysis》,《Annals of Statistics》,《Journal of Applied Probability》等各类国际期刊发表大量的论文,并出版了专著《Stochastic Analysis with Financial Applications》,《Stochastic Analysis in Discrete and Continuous Settings: With Normal Martingales》,《An Elementary Introduction to Stochastic Interest Rate Modeling》。在随机分析和金融数学领域有很高的造诣。



Nicolas Privault教授精彩讲座

由于多年在多个国家和地区的交流和工作的, Privault 教授精通中文、英文和法文。报告开始, Privault 教

授首先用中文感谢了精算研究院的邀请并向大家简要地介绍了报告的内容梗概，随后他用英文向大家深入浅出地介绍跳过程在金融中的引进发展历程，并将连续过程的随机计算推广到跳过程，最后基于跳过程的随机计算，Privault 教授向大家介绍了应用跳过程模拟金融市场股票波动时相关衍生品的定价与对冲问题。Privault教授的讲座深入浅出，在完整介绍跳过程的理论内容的同时也针对现在研究跳过程的前沿做出了一些延伸。不仅让同学们对跳过程的随机微积分有了一定的了解，同时也对未来此领域的研究方向有了直接的认识。

报告结束后，Privault 教授与中国精算研究院的孟辉和伍慧玲老师和Privault教授对于跳模型下的相关金融问题进行了讨论，与同学们热情交流了他在这个研究领域的心得体会，并介绍了他所在的南洋理工大学，表示乐于接受希望去南洋理工大学读博士的同学的咨询。

编辑：孙颖

版权所有：中央财经大学 学院南路校区地址：北京市海淀区学院南路39号 邮编：100081

沙河校区地址：北京市昌平区沙河高教园区 邮编：102206

(C)Copyright 2006 www.cufe.edu.cn All Rights Reserved