

作者：吴臻 来源：山东大学 发布时间：2009-5-3 11:33:50

小字号

中字号

大字号

彭实戈院士入选国际数学家大会一小时报告人

是第一位被邀请作一小时报告的中国大陆数学家



近日，中科院院士、山东大学数学学院彭实戈教授受国际数学家大会组委会主席M. S. Raghunathan教授的正式邀请，将出席2010年在印度召开的第26届国际数学家大会并作一小时报告。在该大会的历史上，彭实戈院士是第一位被邀请作一小时报告的中国大陆数学家。

彭实戈院士在随机最优控制系统的最大值原理、倒向随机微分方程理论和非线性数学期望理论的研究方面取得了国际领先水平的研究成果，产生了重要影响。彭实戈院士和Pardoux合作于1990年发表的文章被认为是倒向随机微分方程理论的奠基性工作。他创建了非线性Feynman-Kac公式，证明了一大类二阶非线性偏微分方程的解可以通过倒向随机微分方程的解来表示。获得了最优控制的一般随机最大值原理，被认为是该领域“最近二十年来两个主要进展”之一，被称为“彭最大值原理（Peng's maximum principle）”。彭实戈院士建立了非线性数学期望——g-期望理论并获得与经典著名结果相应的g-上鞅分解定理和概率模型具有不确定性情况下的新的大数定律和中心极限定理。创立了非线性期望下的G-正态分布和G-布朗运动的理论基础，并将上述成果应用于研究动态金融产品定价和风险度量。以彭实戈院士为第一负责人的国家自然科学基金委“九五”重大项目《金融数学、金融工程和金融管理》有力地推动了“金融数学”这门新兴学科在中国的发展。彭实戈院士现为国家973计划“金融风险控制中的定量分析与计算”重大项目首席科学家。

国际数学家大会由国际数学联盟主办，简称ICM，是全球数学界最高水平的学术会议，素有国际数学“奥运会”之称。首次会议于1897年在瑞士苏黎世召开，已有100多年的历史，一般4年一次。第24届国际数学家大会（2002年）第一次在我国北京举行。大会每次都邀请一批杰出数学家在大会上作一小时的学术报告和学科组的分组会上作45分钟学术报告。

[更多阅读](#)

[彭实戈院士：倒向随机微分方程理论在金融决策中的应用](#)

[中国三科学家获08年度陈嘉庚科学奖](#)

发E-mail给：

GO

发表评论

相关新闻

[国际知名数学家陈繁昌将任香港科大新校长](#)

[石根华：一位数学家的41年传奇](#)

[华裔数学家丘成桐痛陈当代中国高等教育七大弊端](#)

[华裔数学家丘成桐：不赞成高校招怪才](#)

[美数学家发明“魔镜” 影像不会反转](#)

[胡晓东谈记忆中的陈景润：他并非呆板而是特别执著](#)

[王元院士：陈景润是如何做数学的](#)

[陈景润夫人由昆专访：怜子如何不丈夫](#)

一周新闻排行

[基金委公布09年度自然科学基金申请初审结果](#)

[《科学新闻》：当南开遇上饶子和](#)

[各高校近40万人搞科研 已筹措654.5亿科研...](#)

[评论：袁隆平发过几篇论文](#)

[光明日报：学术测谎仪背后的警示](#)

[四华裔科学家当选09年度美国国家科学院院士](#)

[华裔才女获哈佛耶鲁等美四名校争抢](#)

[日本政府（文部科学省）博士生奖学金项目候选人确定](#)