

Univ.-Prof. Dr. Michael Oberguggenberger

Institut für Grundlagen der Bauingenieurwissenschaften

Workshop Stochastic Analysis, Lévy processes and (B)SDEs

Kooperationspartner: Prof. Dr. Francesco Russo (Ecole Nationale Supérieure des Techniques Avancées Paris)

Das Workshop "Workshop Stochastic Analysis, Lévy processes and (B)SDEs" fand vom 3. bis 7. Oktober am Grillhof statt. Das Kürzel "(B)SDEs" bezeichnet "(backward) stochastic differential equations". Insgesamt umfasst die Thematik Differentialgleichungen, die durch Zufallsprozesse angetrieben werden. Die Lösungen dieser Differentialgleichungen sind von großer Bedeutung in Technik, Natur- und Wirtschaftswissenschaften, etwa in der stochastischen Strukturmechanik und ganz besonders in der Finanzmathematik (Optionsbewertung). Bei dem von Univ.-Prof. Dr. Stefan Geiß und Dr. Christel Geiß (Institut für Mathematik, Universität Innsbruck) organisierten Workshop konnten 40 internationale Vortragende gewonnen werden, darunter sieben aus Frankreich.

Dank der Förderung durch den Frankreichschwerpunkt wurden die Teilnahme und der Vortrag von Prof. Francesco Russo ermöglicht. Prof. Russo ist einer der bedeutendsten und international einflussreichsten Repräsentanten der stochastischen Analysis. Seine Teilnahme war sicherlich ein Anziehungspunkt für die Tagung. Darüberhinaus konnte die langjährige Zusammenarbeit mit dem Antragsteller und Kollegen des Instituts fortgesetzt werden.

Das Programm findet man kann auf der Webseite

<http://stochastics-mathematics.uibk.ac.at/workshop/index.html>.