

# Stochastická analýza a její aplikace

Vážené kolegyně, vážení kolegové,

- ve dnech **6.-7.1.2005**
- v seminární místnosti KPMS v karlínské budově MFF UK

se uskuteční

*workshop se zaměřením na stochastickou analýzu,  
stochastické diferenciální rovnice a příslušné aplikace.*

Program semináře spolu s abstrakty přednášek je možné nalézt na adrese

- <http://www.karlin.mff.cuni.cz/~kpms/workshop.htm>

Na příslušnou www-stránku je možné se dostat ze stránky katedry KPMS volbou *akce* a *Stochastická analýza a její aplikace*.

Program počítá s délkou příspěvků 50 min a diskuzí 10 min. Přednášejícím bude k dispozici tabule, zpětný a datový projektor. Jednací řeč bude čeština i angličtina.

Ostatní informace budou k dispozici na výše uvedené webové stránce.

Na Vaši účast se těší

Petr Dostál  
předseda organizačního výboru  
[dostal@karlin.mff.cuni.cz](mailto:dostal@karlin.mff.cuni.cz)

# Program semináře

## čtvrtek 6.1.

- 10:45 - 11:45 B.Maslowski  
*Ergodická teorie pro stochastické rovnice v nekonečně-  
dimenzionálním prostoru*
- 11:45 - 13:30 *přestávka na oběd*
- 13:30 - 14:30 J.Večeř  
*Gambler's Ruin Problem with Relative Wealth Perception*
- 14:30 - 15:30 K.Janeček  
*Futures Trading Model with Transaction Costs*
- 15:30 - 16:00 *káva*
- 16:00 - 17:00 A.Černý  
*Performance of Dynamic Hedging Strategies or How Not To  
Throw Away Million Dollars*
- 17:00 - 18:00 P.Dostál  
*Asymptotická analýza strategií obchodování s akcií při  
existenci transakčních nákladů*
- 19:00 - 22:00 *večeře*

## pátek 7.1.

- 10:00 - 11:00 V.Beneš  
*Nelineární filtrace v Coxových bodových procesech*
- 11:00 - 12:00 J.Seidler  
*Exponential and  $L^p$ -estimates for stochastic convolutions*
- 12:00 - 13:30 *přestávka na oběd*
- 13:30 - 14:30 J.Hannig  
*Small Deviations*
- 14:30 - 15:30 M.Ondreját  
*Brownovské representace ve vektorové stochastické analýze.*