

Stochastická analýza a její aplikace III

Poslední oznámení

Vážené kolegyně, vážení kolegové,

- ve dnech **5.-6.1. 2007**
- se v seminární místnosti KPMS MFF UK, Sokolovská 83, Praha 8, Karlín uskuteční

3. 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/workshopIII.htm>

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

Program počítá s délkou příspěvků 45 min a diskuzí 5 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

Program workshopu

Pátek 5.1.		Chairman
9:00 - 9:30	registrace	V. Beneš ↓
9:30 - 10:20	J. Seidler · ÚTIA ČR, Praha, ČR <i>Exponential estimates for stochastic convolutions in 2-smooth Banach spaces</i>	
10:20 - 11:10	J. Večeř · Columbia University, New York, USA <i>Lessons Learned from FIFA World Cup 2006 Betting Markets</i>	
11:10 - 12:00	J. Pospíšil · Západočeská univerzita, Plzeň, ČR <i>Ergodicity and parameter estimates for infinite-dimensional fractional Ornstein-Uhlenbeck process</i>	
12:00 - 13:30	přestávka na oběd	K. Janeček ↓
13:30 - 14:20	M. Šmíd · ÚTIA ČR, Praha, ČR <i>Optimal Decision Making in a Limit Order Market</i>	
14:20 - 15:10	A. Černý · City University London, London, UK <i>On The Structure of General Mean-Variance Hedging Strategies</i>	
15:10 - 16:00	P. Dostál · KPMS MFF UK, Praha, ČR <i>δ-optimal trading strategies for small transaction costs</i>	
16:00 - 16:30	káva	A. Černý ↓
16:30 - 17:20	K. Janeček · RSJ Invest, a.s., Praha, ČR <i>How to properly estimate the level of transaction costs</i>	
17:20 - 18:10	J. Swart · ÚTIA ČR, Praha, ČR <i>Mean-field limits of linearly interacting diffusions</i>	
19:00 - 22:00	večeře	
Sobota 6.1.		
8:30 - 9:00	čaj	J. Večeř ↓
9:00 - 9:50	P. Novotný · Columbia University, New York, USA <i>Comparison of Momentum and Contrarian Trading in Different Markets</i>	
9:50 - 10:40	L. Pospíšil · Columbia University, New York, USA <i>Stochastic Analysis and Credit Risk</i>	
10:40 - 11:10	káva	J. Swart ↓
11:10 - 12:00	L. Košťál · Fyziologický ústav AV ČR, Praha, ČR <i>Variability, entropy and randomness in stationary neuronal signals</i>	
12:00 - 12:50	V. Beneš · KPMS MFF UK, Praha, ČR <i>Levy driven point processes</i>	