

# Stochastická analýza a její aplikace II

*Poslední oznámení*

Vážené kolegyně, vážení kolegové,

- ve dnech **6.-7.1. 2006**
- se seminární místnosti KPMS MFF UK, Sokolovská 83, Praha 8, Karlín uskuteční

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

Program semináře spolu s abstrakty přednášek je množné nalézt na adrese

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

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

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

<b>Pátek 6.1.</b>		<b>Chairman</b>
9:30 - 10:00	registrace	K. Janeček ↓
10:00 - 11:00	P. Lánský · Fyziologický ústav AV ČR, Praha <i>Stochastické metody v početních neurovědách</i>	
11:00 - 12:00	J. Večeř · Columbia University, New York <i>Methods for Early Detection of Market Crashes - Crash and Rally Options</i>	
12:00 - 13:30	přestávka na oběd	P. Lánský ↓
13:30 - 14:30	M. Ondreját · Matematický ústav AV ČR, Praha <i>Nelineární stochastické vlnové rovnice</i>	
14:30 - 15:30	K. Janeček · RSJ Invest, a.s., Praha <i>Optimal investments with proportional profit-share fee</i>	
15:30 - 16:00	káva	J. Večeř ↓
16:00 - 17:00	J. Seidler · ÚTIA AV ČR, Praha <i>Stochastic nonlinear beam equations</i>	
17:00 - 18:00	J. Pospíšil · Západočeská univerzita, Plzeň <i>On Parameter Estimates in Stochastic Evolution Equations Driven by Fractional Brownian Motion</i>	
19:00 - 22:00	večeře	
<b>Sobota 7.1.</b>		
8:30 - 9:00	čaj	V. Beneš ↓
9:00 - 10:00	J. Swart · ÚTIA AV ČR, Praha <i>Pathwise uniqueness for a SDE with non-Lipschitz coefficients</i>	
10:00 - 11:00	P. Dostál · KPMS MFF UK, Praha <i>Optimální obchodní strategie s transakčními náklady placenými pouze za jednu z akcií</i>	
11:00 - 12:00	B. Maslowski · Matematický ústav AV ČR, Praha <i>Stochastic Linear and Semilinear Equations with Gaussian Noises</i>	