



MATEMATICKO-FYZIKÁLNÍ
FAKULTA
Univerzita Karlova



Matematický ústav
Akademie věd ČR

Pozvánka na přednášku
semináře Ústavu teoretické fyziky MFF UK
v úterý 23. května 2017 v 10:40
v 10. patře budovy v Praze 8 – Tróji, V Holešovičkách 2

Open problems in non-standard economic and financial modelling

Prof. Harbir Lamba, George Mason University, USA

Abstrakt: The standard models of economics and finance make some extremely convenient but unjustified assumptions about the aggregated behaviour of the participants within the system. These greatly simplify the mathematics required to the point where many mathematicians do not even consider them interesting research areas.

I shall describe some non-standard financial market models, both agent-based and mesoscopic in nature, and their relationship to, if time permits:

Coupled PDEs with very unusual boundary conditions

Queueing Theory

Generalized Polya urns

Variants of self-organized criticality models

Přednáška se koná ve spolupráci s Matematickým ústavem AV ČR, s podporou Akademie věd ČR v rámci programu Strategie AV21.