

2007 年全国金融数学学术研讨会会议纪要

2007 年全国金融数学学术研讨会在 2007 年 5 月 12-13 日在安徽芜湖举行，本次会议由中国概率统计学会、中国工程概率统计学会、安徽省数学会联合举办，会议由安徽工程科技学院承办，上海交通大学协办。参加会议的有来自包括北京大学、复旦大学、上海交通大学、浙江大学、哈尔滨工业大学、山东大学、华东师范大学、新疆大学、中国科学院应用数学研究所等全国各地 52 所院校和研究所的代表 140 多名，是目前国内金融数学界规模最大的一次盛会。安徽工程科技学院费为银教授主持了 5 月 12 日上午的开幕式，安徽工程科技学院党委书记、副院长陈其工教授代表学院党政领导致欢迎词，中国科学院应用数学研究所严加安院士、中国工程概率统计学会理事长叶中行教授、安徽省数学会副理事长丁万鼎教授分别致词。

大会特邀了著名概率论和金融数学专家严加安院士作了题为“基于 Choquet 积分的新风险度量”的学术报告；原长沙铁道学院副院长、中南大学侯振挺教授作了“马尔可夫骨架过程及其应用”的学术报告；华东师范大学长江学者、美国加州大学尔湾分校郑伟安教授作了“股票的技术分析与随机分析中的几个问题”的学术报告；长江学者、山东大学金融研究院副院长陈增敬教授作了“非线性数学期望与非线性定价”的学术报告；北京大学金融数学系原主任王铎教授作了“异质金融市场资产价格模型的动力学研究”；中国工程概率统计学会理事长、上海交通大学叶中行教授作了“Change filtrations and mean-variance hedging”；华中科技大学杨明教授作了“超生产容量阻止对手进入有效性的实物期权分析”；中国科学院应用数学研究所夏建明副研究员作了“Stock loans”；同济大学梁进教授作了“Convergence rate of BTM for an American option with jump-diffusion”。几位专家的精彩报告受到了全体代表的热烈欢迎。

13 日全天进行分组报告，会上有 44 位代表报告了各自的学术论文和研究成果，参会的代表在分组会议上进行了热烈的讨论与交流。在这次会议中与会代表提交的报告选题范围较广，具有很强的前瞻性。在大家的共同努力下，会议取得了圆满的成功。

会议期间还举行了中国工程概率统计学会常务理事扩大会议，就明年学会年会和换届事宜作出了若干安排。

这次年会从筹备到召开得到了安徽工程科技学院党政领导、有关部门和应用数理系的鼎立支持，他们为开好这次会议从各个方面作了精心的准备和周到的安排，上海交通大学和人民邮电出版社图灵公司为会议提供了部分资助，中国概率统计学会、中国工程概率统计学会、安徽省数学会和全体与会代表为此表示衷心的感谢。

中国概率统计学会
中国工程概率统计学会
安徽省数学会

2007 上海 — 香港保险精算论坛在华东师范大学召开

为了促进上海和香港保险精算事业的加速发展及保险精算理论与实践的有机结合，搭建保险精算各研究方向的交流平台，由中国概率统计学会精算专业委员会、华东师范大学、复旦大学、上海市保险学会、香港大学联合主办，瑞士再保险公司、寰宇投资顾问有限公司协办的 2007 上海 — 香港保险精算论坛于 2007 年 8 月 18 至 19 日在华东师范大学理科大楼 A 座 504 多功能厅举行。论坛的学术委员会主席由国际非寿险精算学会 (ASTIN) 主席、原北美精算学会 (SOA) 主席、加拿大 Waterloo 大学统计与精算学系 Harry H. Panjer 教授担任。来自加拿大 Waterloo 大学、美国 Columbia 大学、美国 Iowa 大学、香港大学、香港中文大学、加拿大 Simon Fraser 大学、复旦大学、浙江大学、西南财经大学、中国人民大学、上海财经大学等学术界和来自瑞士再保险公司、太平洋保险集团、汇丰保险 (亚洲) 有限公司、寰宇金融集团等海内外著名金融机构的实务界代表共 80 余人相聚华东师范大学，共同探讨国际精算领域中的前沿问题。

华东师范大学副校长、校研究生院院长陈群教授出席了论坛开幕式并致欢迎词。开幕式由中国概率统计学会精算专业委员会主任、华东师范大学金融与统计学院院长汪荣明教授主持。此外本次论坛得到了北美精算学会 (SOA) 申请 PD 学分的批准：第一天为 4.5 个学分，第二天为 4 个学分。

目前中国金融市场正在以跳跃发展的方式与国际接轨，金融混业经营的趋势使得银行、保险、证券、信托业务相互融合与渗透，这一方面极大丰富了金融产品与服务的内涵，同时也对金融风险管理技术提出了挑战。正因为现代经济的核心是金融，而金融活动又始终与风险紧密相连，所以，金融领域中的风险管理已构成金融机构的生命线。精算学是建立在概率统计和风险理论基础上，运用多种金融工具对经济活动中的风险进行计量和定价的一门学科。在成熟的金融市场里，精算在保险、投融资、金融监管、社会保障以及其他与风险管理相关的领域里发挥着重要作用。因为本次论坛学术思想新颖，理论与实务结合紧密，学术报告深受与会者的欢迎。

(钱林义 供稿)