

设为首页

加入收藏

English

请输入关键字查找

首页

学院概况

师资队伍

教育教学

学科科研

招生工作

学生工作

党建工作

专任教师 Faculty

首页 / 专任教师 / 副教授

教授

严钧

副教授

发布时间: 2018-10-16 浏览次数: 649

讲师

助教

博士后



姓名： 严钧

研究领域：

随机分析和大偏差理论及其在金融保险中的应用

教育背景：

2000. 9-2004. 7 青岛大学 信息与计算科学 理学学士

2004. 9-2006. 7 武汉大学 概率论与数理统计 理学硕士 导师：高付清

2006. 9-2009. 7 武汉大学 概率论与数理统计 理学博士 导师：高付清

2014. 9-2015. 2 美国韦恩州立大学 访问学者 导师：Gang George Yin

工作经历：

2009. 9-至今 扬州大学 数学科学学院

教学经历:

概率论与数理统计, 统计软件, 时间序列分析, 随机过程等

科研与人才项目:

1. 主持国家自然科学基金青年基金(2014.1-2016.12), , 22万
2. 主持江苏省自然科学基金青年基金(2013.7-2016.6), 20万
3. 主持江苏省高校自然科学基金(2013.8-2015.12), , 3.2万
4. 主持国家天元数学基金(2011.1-2011.12), 3万
5. 主持扬州大学创新培育基金(2012.10-2013.11), 1万
6. 主持扬州大学创新培育基金(2011.10-2012.11), 1万

发表文章:

Yan, Jun. Deviations and asymptotic behavior of convex and coherent entropic risk measures for compound Poisson process influenced by jump times, *Statistics and Probability Letters*, 125, 71-79, 2017.

Yan, Jun. Exponential martingale for compound Poisson process with latent variable and its applications, *Appl. Math. J. Chinese Univ.* 30, 210-216, 2015.

Yan, Jun. Deviations of convex and coherent entropic risk measures, *Statistics and Probability Letters*, 100, 56-66, 2015.

Yan, Jun. Estimations and asymptotic behaviors of coherent entropic risk measure for sums of random variables, *Statistics and Probability Letters*, 91, 171-180, 2014.

严钧. 部分转移的风险过程的中偏差, *数学学报(中文版)*, 57, 675-680, 2014.

严钧, 殷弘. 财产索赔服务期权定价的鞅方法, *应用数学*, 27, 152-156, 2014.

Yan, Jun. Gao, Fuqing. The minimal entropy martingale measure of a jump process influenced by jump times. *Statistics and Probability Letters*, 83, 83-88, 2013.

Yan, Jun, Gao, Fuqing. Exponential martingale and large deviations for a Cox risk process with Poisson shot noise intensity. *Journal of Mathematical Analysis and Applications*, 394, 74-83, 2012.

严钧, 汪宝彬. 部分转移的风险过程的大偏差. *数学杂志*. 32, 1021-1026, 2012

严钧. 基于Esscher变换的指数Ornstein-Uhlenbeck过程的定价. *扬州大学学报(自然科学版)* 15, 17-19, 2012

Yan, Jun. The minimal martingale measure for the pricing process with Poisson shot noise jumps. *Communications on Stochastic Analysis*, 5(4), 671-681, 2011

Gao, Fuqing, Yan, Jun. Sample path large and moderate deviations for risk model with delayed claims. Insurance: Mathematics and Economics. 45, 74 - 80, 2009.

Qian, Bin*, Yan, Jun. Moderate Deviation Principle for Self-Normalized Sums of Sums of i. i. d. Random Variables. Applied Mathematics Letters. 22, 715 - 718, 2009.

Gao, Fuqing, Yan, Jun. Functional large deviations and moderate deviations for Markov-modulated risk models with reinsurance. Journal of Applied Probability, 45, 800-817, 2008.

获奖和荣誉:

1. 教育部高等学校科学研究优秀成果奖(科学技术)自然科学二等奖(排名5), 名称: 随机过程与统计中大偏差理论研究;
2. 扬州大学“科技先锋”

联系地址:

江苏省扬州市邗江区四望亭路180号, 扬州大学瘦西湖校区数学科学学院

电子邮箱:

junyan@yzu.edu.cn

[打印本页](#) [关闭窗口](#)

电话: 0514-87975402

邮编: 225002

地址: 江苏省扬州市四望亭路180号

版权所有: 扬州大学数学科学学院

[学院概况](#) [师资队伍](#)

[教育教学](#) [学科科研](#)

[招生工作](#) [学生工作](#)

[党建工作](#)



关注官方微信