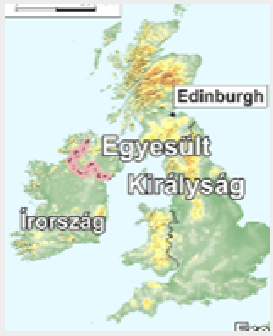
KÜLHONI MAGYAR TUDÓSPORTRÉK

Gyöngy István

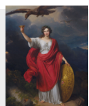
(Budapest, 1951.)

a Magyar Tudományos Akadémia külső tagja



István Gyöngy was born in Budapest in 1951. In 1969—1974 he was a student of the Eötvös Loránd University, he received his diploma with distinction in mathematics, the thesis title: Random sequences (computational complexity). In 1974 he began working as Assistant Professor, at the Department of Mathematics, Faculty of Electrical Engineering, of the Technical University of Budapest, In 1976 he became associate professor, at the Department of Algebra and Number Theory, of the Eötvös Loránd University, then Professor (Docent), of the Department of Probability Theory and Statistics, in 1985—1995. In 1978—81 he was postgraduate student at Moscow State University, in 1981 he obtained PhD degree in mathematics, under the supervision of N.V. Krylov, the title of his thesis was Stochastic evolution equations. Since 1995 he has been working at the University of Edinburgh, he is currently a professor and head of the Probability and Stochastic Analysis research group, personal chair of probability.
Up to 1995 he held several fellowships and visiting positions, among others the Alexander von Humboldt Fellowship in the Goethe University, Frankfurt, West Germany in 1984—85. Later he received several visiting invitations all over the world.
His main research areas are Stochastic differential equations, stochastic partial differential equations and their applications, in nonlinear filtering and stochastic control. In particular, numerical methods. The Gyöngy theorem (or lemma) (Probab. Theory Relat. Fields, 1986, 71, 501—516.) provides a powerful mathematical tool to bridge the gap between

Gyöngy István Budapesten született 1951-ben. 1969—1974-ben az ELTE-n tanult, 1974-ben diplomázott matematikából, kitüntetéssel, szakdolgozatának címe: Véletlenszerű sorozatok: (számítástechnikai komplexitás). 1974-ben a Budapesti Műszaki Egyetem Villamosmérnöki Karán, a Matematika Tanszéken kezdett dolgozni adjunktusként. 1976-ban docens lett az ELTE Algebra és Számelméleti Tanszékén, majd — 1985—1995-ben — professzor a Valószínűség-számítási és Statisztikai Tanszéken. 1978—1981-ben posztgraduális ösztöndíjas volt a Moszkvai Állami Egyetemen, 1981-ben szerzett PhD-fokozatot, témavezetője N. V. Krylov volt. Dolgozatának címe: Sztochasztikus differenciálegyenletek. 1995 óta az Edinburghi Egyetem oktatója, jelenleg professzor, a Valószínűség-számítási és Sztochasztikus Analízis Kutatócsoport vezetője, personal chair. 1995-ig számos ösztöndíja és vendégoktatói—kutatói meghívása volt, többek között 1984—85-ben Alexander von Humboldt-ösztöndíjas volt Frankfurtban a Goethe Egyetemen. Később is sok meghívást kapott a világ különböző egyetemeitől.
Fő kutatási területei a sztochasztikus differenciálegyenletek, a parciális sztochasztikus differenciálegyenletek és alkalmazásaik, nemlineáris szűrőkben és sztochasztikus kontrollelméletekben. Röviden: a numerikus módszerek. A „Gyöngy-formula" (Probab. Theory Relat. Fields, 1986, 71, 501—516.) hatékony matematikai módszer, amelynek segítségével áthidalható a pénzügyi piac (opciós árak) és az őket leíró elméleti modellek közötti különbség.



observable financial market data (option prices) and the theoretical models used to describe them.
He is author/co-author of more than 150 publications. The book Introduction to Stochastic Partial Differential Equations (Stochastic Modelling and Applied Probability) was published in 2017.
He is member of the Edinburgh Mathematical Society, London Mathematical Society, and the Royal Society of Edinburgh (elected in 2005). He is honorary professor of the Hariott—Watt University.
In 2025 he was elected external member of the Hungarian Academy of Sciences in the Section of Mathematical Sciences.
On 1 July he lectured at a workshop organized by HUN-REN SZTAKI and the Mathematical Institute of the Eötvös Loránd University: „Exploring Uncertainty: Stochastic Systems, Risk Management, Machine Learning".

Contact

University of Edinburgh
School of Mathematics
EH9 3FD Edinburgh, The King's Buildings, Peter Guthrie Tait Road
Great-Britain
Tel.: +44 131 6505945
E-mail: i.gyongy@ed.ac.uk

Több mint 150 publikáció szerzője és/vagy társszerzője. Introduction to Stochastic Partial Differential Equations (Stochastic Modelling and Applied Probability) című könyve 2017-ben jelent meg.
Tagja az Edinburghi Matematikai Társaságnak, a Londoni Matematikai Társaságnak. 2005-ben a Skót Tudományos Akadémia tagjává választották, a Heriott-Watt University tiszteletbeli professzora.
2025-ben a Magyar Tudományos Akadémia külső tagjává választották a Matematikai Tudományok Osztályában.
2025. július 1-jén előadást tartott a HUN-REN SZTAKI és az ELTE TTK által szervezett Exploring Uncertainty: Stochastic Systems, Risk Management, Machine Learning című workshopon.

Kapcsolat

University of Edinburgh
School of Mathematics
EH9 3FD Edinburgh, The King's Buildings, Peter Guthrie Tait Road
Nagy-Britannia
Tel.: +44 131 6505945
E-mail: i.gyongy@ed.ac.uk