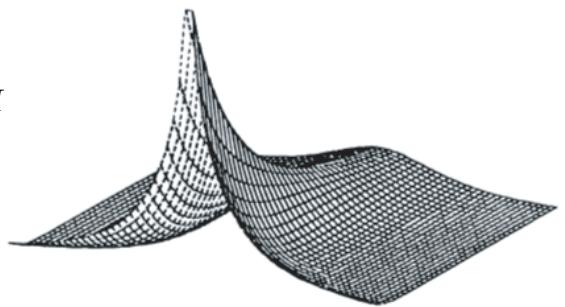




Кафедра ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель - академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

21 ноября — А.Ю. Пилипенко (Институт математики НАН, г. Киев)

О дифференцируемости по начальным данным решений стохастических уравнений с разрывными коэффициентами

Резюме.

Рассматриваются стохастические дифференциальные уравнения, в которых шумом является симметричный устойчивый процесс Леви с параметром $\alpha \in (1; 2]$, а коэффициент переноса имеет ограниченную вариацию. Доказано, что решение п.н. соболевски дифференцируемо по начальному условию, более того, порождает поток гомеоморфизмов. Для производной найдены явные выражения.

Семинар проводится по средам в аудитории 16-24

с 16:45 до 17:45

Координатором семинара на осенний семестр 2012 года назначен к.ф.-м.н., доцент А.П. Шашкин (e-mail: ashashkin@hotmail.com), ученым секретарем семинара - А.Ю. Хапланов (e-mail: KhaplanovA@gmail.com).