



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

1 марта — Г.В. Рябов (Институт математики НАН Украины, Киев)
2017 г.

Преобразования винеровской меры и ортогональные разложения

В докладе будет рассмотрен вопрос о построении ортогонального разложения (аналогичного разложению Ито-Винера) для мер, полученных из винеровской меры преобразованиями типа склейки. Для кратных стохастических интегралов специального вида будет доказана полнота в пространстве квадратично интегрируемых функций относительно новой меры. В некоторых случаях будет предложена явная формула вычисления ортогонального разложения, обобщающая формулу Крылова-Веретенникова. Полученные результаты будут использованы для описания ортогональной структуры пространства квадратически интегрируемых функционалов от потока Арратья и для построения кратных интегралов по потоку Арратья.

**Семинар проводится по средам в аудитории 12-24 Главного Здания
Московского Государственного Университета им. М.В. Ломоносова
с 16:45 до 17:45**

Координатором семинара на весенний семестр 2017 года назначен
д. ф.-м. н. доцент Лебедев Алексей Викторович