



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

29 марта — А.А. Дороговцев (Институт математики НАН Украины, Киев)
2017 г.

Стохастические полугруппы как мультипликативные функционалы от шума Леви

В докладе рассматриваются полугруппы сильных случайных операторов в гильбертовом пространстве. Несмотря на внешнюю схожесть этого объекта с процессами, имеющими мультипликативные независимые приращения, шум, порождённый стохастической полугруппой, может не состоять из гауссовской и скачкообразной компоненты. Приведены достаточные условия на стохастическую полугруппу, при которых она является мультипликативным функционалом от шума Леви. В некоторых случаях получено описание мультипликативных функционалов в терминах рядов из кратных интегралов по шуму. Частным случаем такого представления является известное представление Крылова-Веретенникова для сдвигов функций вдоль решений стохастических дифференциальных уравнений.

Dorogovtsev, Andrey A. Krylov-Veretennikov expansion for coalescing stochastic flows. *Commun. Stoch. Anal.* 6 (2012), no. 3, 421–435.

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