



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

27 марта – А. А. Дороговцев, О. Л. Изюмцева (Институт математики АН, Украина)
2019 г.

Моменты достижения для гауссовских интеграторов

Гауссовские интеграторы — это класс случайных процессов, естественным образом возникающих при построении математических моделей полимеров, а также, при исследовании различных обобщений расширенного стохастического интеграла. При отсутствии независимости приращений и марковского свойства гауссовские интеграторы обладают локальным временем в одномерном случае, перенормированным локальным временем самопересечения в двумерном случае, и многими другими свойствами характерными для винеровского процесса. Однако, отсутствие марковского свойства приводит к тому, что описание функционалов от интеграторов (например, с помощью разложения Ито-Винера) наталкивается на новые сложности. В докладе для двумерного интегратора определяются кратные интегралы Винера (не совпадающие с расширенным интегралом) и приводится разложение в ряд по таким интегралам для момента первого

**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 2019 года назначен
профессор Дмитрий Дмитриевич Соколов