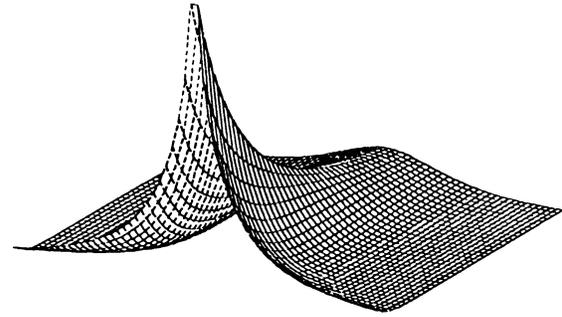




Кафедра ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ



## БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А.Н. Ширяев

18 сентября — **И.Е. Павлюкевич** (Йенский университет им. Ф. Шиллера, Германия)  
2019 г.

### *Об одном уравнении в смысле Стратоновича*

Мы рассмотрим стохастическое дифференциальное уравнение  $dX = |X|^\alpha \circ dB$ ,  $\alpha \in (-1, 1)$ , которое было введено в физической литературе для описания аномальной диффузии в неоднородной среде (см. Cherstvy et al., New Journal of Physics 15:083039, 2013), и опишем все строго марковские однородные решения этого уравнения, проводящие нулевое время в нуле.

Доклад основан на работе *I. Pavlyukevich and G. Shevchenko*, “A Stratonovich SDE with irregular coefficients: Girsanov’s example revisited”, <http://arxiv.org/abs/1812.053245324>

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 осенний семестр 2019 года назначен  
доцент Дмитрий Александрович Шабанов