

5 жовтня 2015 року о 14 год 10 хв

Поток Арратья - это поток броуновских частиц, которые стартуют из всех точек действительной прямой, причем любые две частицы потока движутся независимо до момента встречи, а в момент встречи - склеиваются в одну частицу. Несмотря на то, что каждая частица в потоке совершает броуновское движение, совокупность двух и более траекторий гауссовским процессом не является. Более того, Б. С. Цирельсоном было доказано, что гауссовская часть шума, порождаемого потоком Арратья, тривиальна (такие шумы называют "черными"). В докладе будет рассмотрена процедура построения кратных стохастических интегралов по траекториям потока и построен аналог разложения Ито-Винера для n-точечного движения.

Доповідач: **Рябов Георгій Валентинович**

Дата проведення: 5 жовтня 2015 о 14 год 10 хв.

Місце проведення: 221 аудиторія