

Maciej Wiśniewolski
Uniwersytet Warszawski

Metody wyznaczania momentów w modelu stochastycznej zmienności

W referacie przedstawione zostaną metody probabilistyczne wyznaczania momentów w modelu stochastycznej zmienności będącej geometrycznym ruchem Browna. Przedstawiona zostanie metoda równania transformaty Laplace'a oraz wykorzystanie wiedzy o procesie rozważanym przez Matsumoto oraz Yora przy okazji uogólnienia twierdzenia Pitmana typu $2M - X$. Przedstawiony zostanie związek funkcjonałów geometrycznego ruchu Browna oraz hiperbolicznych procesów Bessla. Jest to nowa probabilistyczna metoda charakteryzacji rozkładu hiperbolicznych procesów Bessla. Referat jest oparty na wspólnej pracy z prof. Jackiem Jakubowskim.