

BARCZY MÁTYÁS

Debreceni Egyetem, Informatikai Kar
Alkalmazott Matematika és Valószínűségszámítás Tanszék

Inhomogén diffúziós folyamatok és hidak

Az inhomogén diffúziós folyamatok és a belőlük származtatott hidak fontos szerepet játszanak a sztochasztikában és alkalmazásaiban. Többdimenziós lineáris inhomogén diffúziós folyamatokra vonatkozó hidakat konstruálunk, megadva ezek integrál- és ún. anticipatív reprezentációját. Egydimenzióban, speciális esetként, külön tárgyaljuk az ún. Ornstein-Uhlenbeck típusú hidakat. Alkalmazásként megvizsgáljuk, hogy mikor esik egybe egy ún. általános α -Wiener híd eloszlása valamely Ornstein-Uhlenbeck típusú híd eloszlásával. Az eredmények Peter Kernel közösek.