

Симметричные процессы Леви с отражением

Павел Иевлев

5 марта 2020 г.

Я расскажу о задаче построения отражающейся версии марковских процессов, о стандартной конструкции процесса с отражением в случае, когда исходный процесс имеет непрерывные траектории и о том, что вообще значит отражение процессов со скачками. Далее я попытаюсь объяснить почему отражение таких процессов может быть нужным и интересным, а также об одной конструкции отражения в случае, когда исходный процесс – это симметричный процесс Леви.

Доклад носит обзорный характер и не предполагает специальных знаний.