

НАЦИОНАЛЕН СЕМИНАР ПО СТОХАСТИКА

секция „Изследване на операциите, вероятности и статистика“

Поредната сбирка на *Националния семинар по стохастика* ще се проведе на **29 юни 2021 г.** (вторник) от **14:00** часа в зала **403** на ИМИ-БАН. Доклад на тема:

"Асимптотика на експоненциални функционали на субординатори"

ще изнесе Мартин Минчев (ФМИ-СУ).

Резюме: Функционали от тип интеграл от експонента от (евентуално експоненциално убит) процес на Леви са обект с приложения във финансовата математика, себеподобните Марковски процеси, себеподобните процеси на разпад и други. В този доклад ще представим някои от резултатите от съвместната работа с проф. Младен Савов, касаещи асимптотичното им поведение, като главен инструмент са Бернщайн-гама функциите, представени от Пати и Савов през 2018. Ще се съсредоточим върху асимптотиката на плътността на тези функционали и нейните производни, чийто явен вид надгражда значително резултат на Хаас и Риберио от 2011 за опашката им.

Докладът е по съвместна статия с Младен Савов: Asymptotic of densities of exponential functionals of subordinator.

Поканват се всички интересуващи се.