

**Броуновское движение:
граничные задачи и распределения функционалов**

Лектор: Альберт Николаевич Ширяев

В функциональных пространствах броуновское движение и связанная с ним винеровская мера играют ту же фундаментальную роль, что и гауссовские случайные величины и их распределения в конечномерных пространствах. Именно броуновское движение явилось тем случайным процессом, который был положен в фундамент современного стохастического исчисления, опирающегося на понятие стохастического интеграла и стохастических дифференциальных уравнений.

В курсе лекций будут рассмотрены (в основном мартингальные) методы исследования распределений различных функционалов от броуновского движения (типа максимума или максимум его модуля) и распределений моментов выхода броуновского движения из некоторых областей.