

dr Kamil Świątek
Instytut Matematyki
Politechniki Poznańskiej

Stochastyczne inkluzje względem dwuparametrowego martyngału

Referat dotyczy zastosowania wielowartościowej całki stochastycznej typu funkcyjnego względem dwuparametrowego martyngału do teorii inkluzji stochastycznych.

W czasie referatu zostanie przedstawiona definicja oraz podstawowe własności wspomnianej wyżej całki. Ponadto zostanie zaprezentowana postać wielowartościowego równania stochastycznego typu funkcyjnego względem dwuparametrowego martyngału, twierdzenie o istnieniu i jednoznaczności rozwiązań tego równania oraz postać stochastycznej inkluzji względem dwuparametrowego martyngału. Głównym wynikiem referatu jest twierdzenie ukazujące związek pomiędzy rozwiązaniami wspomnianego wyżej wielowartościowego równania i rozwiązaniami stochastycznej inkluzji względem dwuparametrowego martyngału.

Bibliografia

- [1] M. Michta, K. Ł. Świątek, *Set-valued stochastic integrals and equations with respect to two-parameter martingales*, Stoch. Anal. Appl. 33 (2015), 40–66.
- [2] M. Kozaryn, M. Michta, K. Ł. Świątek, *Stochastic inclusions driven by two-parameter martingales*, Dynam. Systems Appl. 25 (2016), 123–152.

Informacja o źródle finansowania

Badania prowadzono w ramach Działalności Statutowej nr 04/43/DSMK/0091.