

O graničnom ponašanju slučajnih šetnji

Bojan Basrak

Sažetak: Granično ponašanje slučajnih šetnji jedan je od središnjih problema teorije vjerojatnosti.

Klasični teoremi u ovom području pokazuju kako adekvatno centrirane i reskalirane slučajne šetnje konvergiraju po distribuciji k Brownovom gibanju.

Ukoliko koraci šetnje zadovoljavaju uvjet regularne varijacije u ulozi limesa se mogu pojaviti i drugi tzv. stabilni Levyjevi procesi.

Pokazat ćemo kako neke šetnje sa zavisnim, ali stacionarnim koracima mogu imati iste limese, no pri tom je ključno dobro odabrati topologiju na prostoru puteva slučajnih šetnji.

Predavanje se zasniva na zajedničkom radu s Danijel Krizmanićem (Sveučilište u Rijeci) i Johanom Segersom (Université catholique de Louvain)