

Selbstähnliche Markovprozesse und Sprung SDEs

Leif Döring, Zürich

Abstract:

Ausgehend von einer expliziten Darstellung aller positiver selbstähnlicher Markovprozesse (Lamperti Darstellung) wurden in den vergangenen Jahren alle selbstähnliche Markovprozesse mit nicht-negativen Pfaden konstruiert. In dem Vortrag diskutiere ich eine Konstruktion per Sprung SDEs. Dieser Ansatz ist robust und kann auf reelle selbstähnliche Markovprozesse ausgedehnt werden.