

Anàlisi Estocàstica

Resum de la línia de recerca. El grup estudia diversos aspectes de la Anàlisi estocàstica: equacions diferencials estocàstiques multidimensionals dirigides per un moviment Brownià fraccionari, aplicacions del càlcul de Malliavin a la estimació de densitats de funcions mesurables d'un procés isonormal Gaussià, càlcul estocàstic amb processos Brownians bifracionaris i processos Gaussians generals, existència de temps locals, formules de Itô, comportament asimptòtic de funcionals no lineals de processos Gaussians, etc..