

Dr hab. Tomasz Kania

Wzajemna ciągłość rozkładów procesów Ornsteina-Uhlenbecka

Przedmiotem naszych rozważań będą procesy Ornsteina-Uhlenbecka względem procesów Levy'ego na (możliwie nieskończenie wymiarowych) przestrzeniach Hilberta. Pokażemy, że dwa takie procesy mają one równoważne rozkłady (traktując je jako abstrakcyjne zmienne losowe) wtedy i tylko wtedy, gdy operatory kowariancji ich części wienerowskich w dekompozycji Ito mają ściśle dodatnie wartości własne. Ponadto pokażemy, że dla procesów czysto skokowych, absolutna ciągłość rozkładu jednego względem drugiego implikuje równość prawie wszędzie.