

# XVI Konferencja z Probabilistyki

26-30 kwietnia 2021 r.

## Program

[wersja na dzień 22 kwietnia 2021 r.]

### Poniedziałek, 26 kwietnia

Przewodniczący sesji: **Łukasz Stettner**

9.00-9.10 **Rozpoczęcie**

9.10-9.50 **A. Jakubowski**, *Kierunkowa dystrybuanta pozorna dla stacjonarnych pól losowych*

9.55-10.15 **K. Bogdan**, *Nierówność Burkholdera a dywergencja Bregmana*

10.20-10.40 **A. Osękowski**, *Optymalne oszacowania dla średnicy procesu pajęczego*

10.45-11.05 **K. Dębicki**, *Czas pobytu procesu gaussowskiego nad wysoką barierą*

11.30-11.50 **J. Jakubowski**, *Formuła splotowa dla czasu lokalnego dyfuzji z odbiciem w zerze*

11.55-12.15 **T. Komorowski**, *Centralne twierdzenie graniczne dla fluktuacji rozwiązania równania KPZ na torusie*

12.20-12.40 **B. Jasiulis-Gołdyn**, *Asymptotyczne własności funkcji odnowy związanej z transformatą Williamsona*

12.45-13.05 **M. Wiśniewolski**, *O reprezentacji całki Wienera-Itô dla punktowych procesów Poissona*

Przewodniczący sesji: **Jacek Jakubowski**

15.00-15.40 **J. Obłój**, *Analiza wrażliwości względem modelu w problemach optymalizacji*

15.45-16.05 **D. Zawisza**, *Problem inwestora w modelu HJM*

16.10-16.30 **A. Rygiel**, *Wycena opcji w semi-statycznym modelu rynku finansowego z kosztami transakcji*

16.35-17.05 **Z. Miśkiewicz**, *Zmiany czasu i procesy przełącznikowe w modelowaniu zmienności stochastycznej*

17.10-17.30 **M. Pitera**, *Warunkowe drugie momenty i ich własności*

17.35-17.55 **K. Krystecki**, *Ruina dwuwymiarowego ruchu Browna z dryfami powiązanymi z kapitałem początkowym*

## Wtorek, 27 kwietnia

Przewodniczący sesji: **Adam Jakubowski**

- 9.00-9.40 **D. Buraczewski**, *Gałązkowy spacer losowy*  
9.45-10.05 **J. Kozicki**, *Proces gałązkowy w nieskończonych układach cząstek*  
10.10-10.30 **P. Dyszewski**, *Spacer losowy z rzadkimi losowymi zaburzeniami*  
10.35-10.55 **J. Wesołowski**, *Własność Matsumoto-Yora dla grafowych rozkładów Dirichleta*  
11.30-12.00 **M. Lis**, *Model dimerów z wolnymi warunkami brzegowymi*  
12.05-12.25 **K. Bisewski**, *Bounds on the expected supremum of fractional Brownian motion with drift*  
12.30-12.50 **K. Kępczyński**, *Asymptotyki rozkładu supremum dwuwymiarowego ułamkowego ruchu Browna*

Przewodniczący sesji: **Leszek Słomiński**

- 15.00-15.40 **T. Grzywny**, *Podporządkowane procesy Markowa*  
15.45-16.05 **M. Niewęglowski**, *Wielowymiarowe procesy Hawkes'a i ich zgodności*  
16.10-16.30 **A. Rozkosz**, *Asymptotyka funkcji wartości w nieliniowych problemach stopowania*  
16.35-16.55 **D. Jelito**, *Stopowanie optymalne z kryterium wrażliwym na ryzyko i nieograniczoną funkcją kosztu końcowego*  
17.00-17.20 **Ł. Stettner**, *Sterowanie impulsowe procesem Markowa z kryterium średni koszt na jednostkę czasu*  
17.25-17.45 **D. Nowakowski**, *Modelowanie stochastyczne wpływu zanieczyszczeń powietrza na choroby układu otolaryngologicznego*

## Środa, 28 kwietnia

Przewodniczący sesji: **Krzysztof Bogdan**

- 9.00-9.40 **O. Kulyk**, *Oszacowania momentów i uśrednianie stochastyczne dla systemów dwuskalowych z szumem Lévy'ego*  
9.45-10.05 **W. Bednorz**, *On the generalization of the Bernoulli Conjecture and its consequences*  
10.10-10.30 **Z. Palmowski**, *O stałej w twierdzeniu Kestena raz jeszcze*  
10.35-10.55 **B. Kołodziejek**, *Proces typu Fleminga-Viota i równanie  $X \stackrel{d}{=} AX + B$*   
11.30-11.50 **A. Falkowski**, *Stochastyczne równania różniczkowe z odbiciem zależnym od rozkładu*  
11.55-12.15 **T. Klimsiak**, *Stochastyczne równania różniczkowe wstecz z nielokalną zależnością od martyngału*  
12.20-12.40 **M. Rzymowski**, *Stochastyczne równania różniczkowe wstecz z barierami opcjonalnymi na przestrzeni z ogólną filtracją*  
12.45-13.05 **D. Tarłowski**, *O rozróżnialności układów deterministycznych i stochastycznych na podstawie trajektorii. Przypadek ciągły*

## Czwartek, 29 kwietnia

Przewodniczący sesji: **Zbigniew Palmowski**

9.00-9.40 **W. Samotij**, *Wielkie odchylenia w grafach losowych*

9.45-10.05 **D. Kępa-Maksymowicz**, *Jedyność losowych pól Gibbsa z nieograniczonymi oddziaływaniami na grafach z nieograniczonym stopniem*

10.10-10.30 **T. Gałazka**, *Ważone nierówności dla  $q$ -funkcji*

10.35-10.55 **R. Łochowski**, *Uniwersalne oszacowania momentów i ogonów czasów wyjścia procesów Bessla*

11.30-12.00 **M. Strzelecki**, *Od nierówności Dooba do oszacowań związanych z operatorem Hardy'ego*

12.05-12.25 **B. Polaczyk**, *Modified log-Sobolev inequalities, Beckner inequalities and moment estimates*

12.30-12.50 **M. Barski**, *Równania CIR z procesem Lévy'ego*

Przewodniczący sesji: **Tomasz Komorowski**

15.00-15.40 **K. Szpojankowski**, *Kumulanty boolowskie w wolnej probabilistyce*

15.45-16.05 **G. Serafin**, *Centralne twierdzenie graniczne dla  $U$ -statystyk*

16.10-16.30 **M. Świeca**, *Metoda ansatzu macierzowego dla ASEP-u z otwartymi brzegami w przypadku singularnym*

16.35-16.55 **A. Zięba**, *Infinitesimal generators of quadratic harnesses*

## Piątek, 30 kwietnia

Przewodniczący sesji: **Zbigniew Jurek**

9.00-9.30 **R. Wieczorek**, *Hybrydowe modele indywidualne populacji komórkowych*

9.35-9.55 **R. Rudnicki**, *Własności rozkładów położenia i prędkości w bilardzie stochastycznym*

10.00-10.20 **T. Szarek**, *Losowe układy dynamiczne na okręgu i prostej*

10.25-10.45 **D. Komorek**, *O ciągłej zależności w problemie zbieżności iteracji losowych*

10.45-10.50 **Zakończenie konferencji**