

Université de Monastir

Faculté des Sciences de Monastir



## Professeur YULIIA MISHURA

Département de Probabilités, Statistiques et Mathématiques Actuarielles

Taras Shevchenko National University of Kyiv, Ukraine

Invitée de l'Ecole Doctorale Sciences et Techniques de l'information

Et ce **du 26 au 31 Octobre 2015**, elle présentera un mini-cours, à **la salle des séminaires du Département de Mathématiques**, selon le programme ci-dessous. **Ce cours correspond à 5 crédits.**

Date	Titre
Lundi 26-10-2015 <b>8h45-10h15</b>	Fractional Brownian motion: Hurst index, covariance function, trajectories properties, quadratic variation.
Mardi 27-10-2015 <b>8h45-10h15</b>	Elements of fractional calculus. Pathwise integration with respect to fractional Brownian motion. Upper bounds for the integrals. Mixed fBm and its properties.
Mercredi 28-10-2015 <b>8h45-10h-15</b>	Stochastic differential equations involving fBm. Existence and uniqueness of the solution. Moment inequalities and properties of the solutions.
Jeudi 29-10-2015 <b>8h45-10h15</b>	Mixed stochastic differential equations involving the Wiener process and fBm. Statistical estimates, Financial applications.

---

Information: [mounir.zili@fsm.rnu.tn](mailto:mounir.zili@fsm.rnu.tn)