

УДК 517.596.4

С. Д. Івасишен¹, Г. С. Пасічник^{1,2}

ЗАДАЧА КОШИ ДЛЯ РІВНЯННЯ ФОККЕРА – ПЛАНКА – КОЛМОГОРОВА БАГАТОВИМІРНОГО НОРМАЛЬНОГО МАРКОВСЬКОГО ПРОЦЕСУ

Наведено результати дослідження фундаментального розв'язку, коректної розв'язності задачі Коші та інтегрального зображення розв'язків для рівняння Фоккера – Планка – Колмогорова одного класу нормальних марковських процесів.

ЗАДАЧА КОШИ ДЛЯ УРАВНЕНИЯ ФОККЕРА – ПЛАНКА – КОЛМОГОРОВА МНОГОМЕРНОГО НОРМАЛЬНОГО МАРКОВСКОГО ПРОЦЕССА

Приведены результаты исследования фундаментального решения, корректной разрешимости задачи Коши и интегрального представления решений для уравнения Фоккера – Планка – Колмогорова одного класса нормальных марковских процессов.

CAUCHY PROBLEM FOR THE FOKKER – PLANCK – KOLMOGOROV EQUATION OF MULTIDIMENSIONAL NORMAL MARKOV PROCESS

The results of investigation for the fundamental solution, correct solvability of the Cauchy problem and integral representations of solutions for the Fokker – Planck – Kolmogorov equation for a class of normal Markov processes are presented.

¹ Нац. техн. ун-т України
«Київ. політех. ін-т», Київ,

² Ін-т прикл. проблем механіки і математики
ім. Я. С. Підстригача НАН України, Львів

Одержано
22.05.09