

# Asymptotyki rozkładów supremum dwuwymiarowych procesów gaussowskich

Krzysztof Kępczyński

24 października 2019

## Streszczenie

Referat będzie dotyczył asymptotyk rozkładu supremum dwuwymiarowego ułamkowego ruchu Browna z dryfem liniowym w skończonym odcinku czasu. Będzie zawierał dokładne wyniki uzyskane w wielu interesujących przypadkach (np. dla Ruchu Browna). Zaprezentowane zostaną wyniki własne autora uogólniające pracę Lieshout, P., Mandjes, M. (2007). *Tandem Brownian queues*. Przedstawione zostaną również motywacje stojące za rozważaniem owego modelu wywodzące się z teorii kolejek oraz matematyki finansowej.