



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

3 декабря — Г.А. Зверкина

2014 г.

Московский государственный университет путей сообщения (МИИТ)

О слабой сходимости распределения одномерного кусочно-линейного марковского процесса к стационарному

Кусочно-линейные марковские процессы (КЛМП) были введены Б.В.Гнеденко и И.Н.Коваленко в 1966 г. как удобный аппарат для исследования поведения СМО. Важную роль в ТМО имеет исследование сходимости и предельных распределений КЛМП, описывающих СМО, этому вопросу посвящены многие исследования. Однако не всегда известен точный алгоритм определения констант в оценке скорости сходимости (для различных типов оценки скорости и в различных метриках). Как правило, для большинства СМО скорость сходимости зависит от стационарного распределения. Вероятно, впервые стационарное распределение КЛМП для СМО с неэкспоненциальным временем обслуживания было описано Б.А.Севастьяновым (1957), но до сих пор стационарное распределение КЛМП не было описано в общем виде. В докладе будут даны необходимые и достаточные условия сходимости КЛМП к стационарному распределению, описано стационарное распределение, и дан пример использования этого стационарного распределения для оценки скорости сходимости распределения СМО к стационарному распределению в метрике полной вариации. В докладе будут использованы некоторые идеи А.Ю. Веретенникова.

**Семинар проводится по средам в аудитории 12-24 Главного Здания
Московского Государственного Университета им. М.В. Ломоносова
с 16:45 до 17:45**

Координатором семинара на осенний семестр 2014 года назначен
доцент Анатолий Дмитриевич Манита,
ученым секретарем семинара — В.В. Карпушин