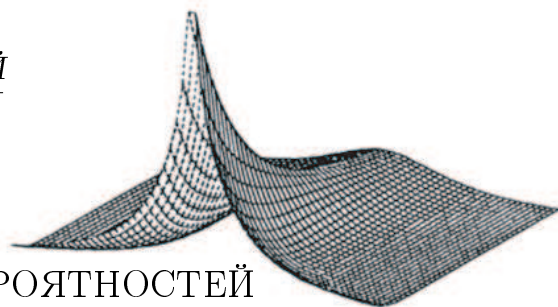




БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

8 апреля — Нагаев С.В. (Институт математики им. С.Л. Соболева СО РАН)
2015 г.

Спектральный метод и цепи Маркова с произвольным фазовым пространством.

Разработана модификация спектрального метода, пригодная для доказательства предельных теорем для общих в смысле эргодических свойств цепей Маркова. Суть этого метода заключается в применении к цепям Маркова спектральной теории банаховых алгебр. Первый вариант спектрального метода был предложен автором настоящего доклада в 1957 г. С тех пор этот метод использовался во многих работах разных авторов. Однако применение спектрального метода до сих пор ограничивалось равномерно эргодичными цепями Маркова, т.е. цепями, для которых скорость стремления к стационарному распределению не зависит от начального состояния. Между тем, многие цепи Маркова, используемые в приложениях, в частности счетные цепи, не являются равномерно эргодичными. Прогресс достигнут за счет ранее неизвестного представления резольвенты линейного оператора в функциональном пространстве.

**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 весенний семестр 2015 года назначен
профессор Сенатов Владимир Васильевич,
ученым секретарем семинара — Е.О. Фоминых