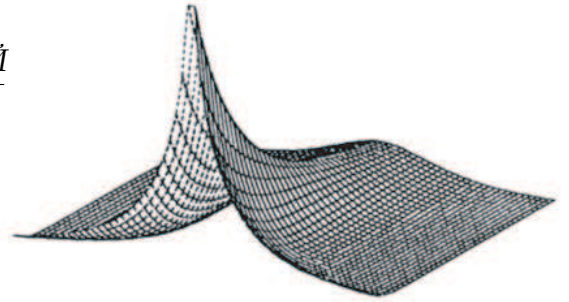




Кафедра ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ



## БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель - член-корр. РАН, профессор А. Н. Ширяев

3 марта — **Хихол Семен Александрович** (МГУ)

*Вычисление обобщенного процесса плотности распределений семимартингалов с независимыми приращениями и его применения.* Предзащита кандидатской диссертации. Научный руководитель - д. ф.-м. н., профессор Гуштин А. А.

### **Резюме.**

В первой части доклада будут представлены два выражения для обобщенного процесса плотности распределений двух семимартингалов с независимыми приращениями. Данный результат обобщает хорошо известное выражение для процесса плотности в случае, когда одно из распределений локально абсолютно непрерывно относительно другого, а также формулу, полученную К. Сато для процесса плотности распределений процессов Леви без требования о локальной абсолютной непрерывности.

Во второй части доклада будут изложены результаты, основанные на полученных формулах для обобщенного процесса плотности и имеющие самостоятельный интерес.

1. Оказывается, что усреднение локальных характеристик по времени преобразует семимартингал с независимыми приращениями в процесс Леви, который "ближе" к любому процессу Леви, чем исходный процесс. "Большая близость" процессов понимается как большая близость всех  $f$ -дивергенций между их распределениями, что также допускает эквивалентную формулировку в терминах сравнения соответствующих бинарных статистических экспериментов.

2. Установлен критерий эквивалентности бинарных экспериментов, составленных из распределения семимартингала с независимыми приращениями и распределения процесса Леви.

**Семинар проводится по средам в аудитории 16-24  
с 16:45 до 17:45**

Координатором семинара на весенний семестр 2010 года назначен д.ф.-м.н., доцент кафедры теории вероятностей Сергей Анатольевич Пирогов (e-mail: pirogov@mail.ru), ученым секретарем семинара - Айгуль Тилековна Абакирова (e-mail: abakirova@gmail.com).