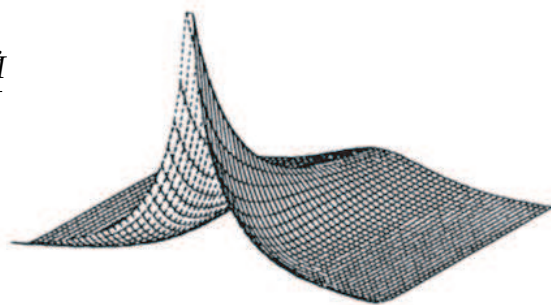




Кафедра ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

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

22 сентября — предзащиты диссертаций аспирантов кафедры.

Белорусов Т. Н. *"Системы обслуживания с возможностью неприсоединения к очереди"*.

Научный руководитель - проф., д.ф.-м.н. Афанасьева Л. Г.

Изучаются системы обслуживания с возможностью неприсоединения к очереди, представляющие собой обобщение систем с отказами. Пусть в момент прихода нового требования в систему в ней уже находится j требований. Тогда пришедшее требование присоединяется к очереди с вероятностью f_j , а с вероятностью $1-f_j$ покидает систему. Устанавливаются условия эргодичности таких систем для различных последовательностей вероятностей $\{f_j\}$.

Карапетян Н. В. *"Математические модели страхования с выплатой дивидендов"*.

Научный руководитель - проф., д.ф.-м.н. Булинская Е. В.

В работе изучаются модели работы страховой компании в непрерывном времени. Предложен алгоритм нахождения и получен явный вид для величины дивидендов, выплаченных до разорения, убытков при разорении и времени до разорения. Исследован вопрос оптимальности дивидендной и перестраховочной стратегий, используемых компаниями.

Ярцева Д. А. *"Стохастические актуарные модели, учитывающие перестрахование"*.

Научный руководитель - проф., д.ф.-м.н. Булинская Е. В.

В диссертации изучаются модели функционирования страховой компании в дискретном времени. Получены оценки убытков компании, среднего времени до разорения, средних дисконтированных дивидендов, выплаченных до разорения, при условии, что компания использует барьерную стратегию выплаты дивидендов и пропорциональное перестрахование. Также исследованы вопросы устойчивости модели к изменению распределения выплат и существования предельных распределений капитала..

А также

Соболев В. Н. (РГТЭУ) *"Оптимизация асимптотических разложений в центральной предельной теореме"*.

В докладе будут представлены новые результаты, связанные с асимптотическими разложениями в центральной предельной теореме. Все эти результаты сопровождаются явными оценками точности разложений.

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

Координатором семинара на осенний семестр 2010 года назначен к.ф.-м.н., доцент кафедры теории вероятностей Алексей Викторович Лебедев (e-mail: avlebed@yandex.ru), ученым секретарем семинара - Айгуль Тилековна Абакирова (e-mail: abakirova@gmail.com).