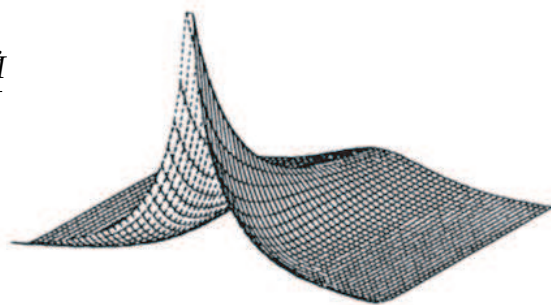




Кафедра ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

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

2 марта — Марат Бурнашев (ИППИ РАН)

(совместно с А. Tchamkerten, Telecom ParisTech.)

Об оценивании моментов остановки случайного процесса по зашумленным наблюдениям

Резюме.

Для гауссовского случайного блуждания X со сносом рассматривается задача оценивания момента τ_A первого пересечения заданного уровня A по наблюдениям коррелированного с X процесса Y . В качестве оценки разрешается любой момент остановки η относительно процесса Y . Рассматриваются два вида процессов Y : зашумленная версия процесса X и процесс X с задержкой (запаздыванием) d . Для заданной функции потерь $f(z)$ в обоих случаях находится точная асимптотика минимально возможного риска при $A \rightarrow \infty$.

Семинар проводится по средам в аудитории 12-25

с 16:45 до 17:45

Координатором семинара на весенний семестр 2011 года назначен д.ф.-м.н., профессор В. Н. Тутубалин, ученым секретарем семинара - Амир Алиев (e-mail: amiraliev@gmail.com).