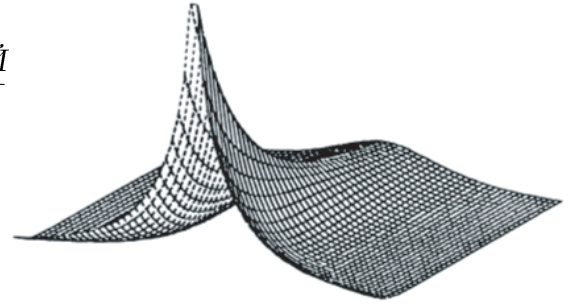




Кафедра ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

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

12 октября– **Дмитрий Коршунов** (Институт математики им. С. Л. Соболева)
Основные свойства распределений, свёртка которых имеет эквивалентный хвост

Доклад посвящён асимптотическому поведению хвостов двукратных свёрток $\overline{F} \star \overline{F}$ неограниченных справа распределений и асимптотическому поведению хвостов распределений случайных сумм S_τ . Сначала будет дано описание всех возможных значений пределов отношений $\overline{F} \star \overline{F}(x)/\overline{F}(x)$ при $x \rightarrow \infty$. Эта задача тесно связана с задачей описания нижних пределов этого отношения и восходит к В. Рудину (1973). Вторая часть доклада посвящена условиям, при которых $\mathbb{P}\{S_\tau > x\} \sim \mathbb{E}\tau \overline{F}(x)$ при $x \rightarrow \infty$. Мы также расскажем о приложениях полученных результатов к теории субэкспоненциальных и подобных распределений, а также приложения к случайным блужданиям, сложным пуассоновским распределениям, безгранично делимым распределениям и ветвящимся процессам.

Foss, S., Korshunov, D., and Zachary, S. (2011). *An Introduction to Heavy-Tailed and Subexponential Distributions*. Springer: New York.

Семинар проводится по средам в аудитории 16-24

с 16:45 до 17:45

Координатором семинара на осенний семестр 2011 года назначен д.ф.-м.н., профессор А. В. Булинский, научным секретарем семинара - Айгуль Абакирова (e-mail: abakirova@gmail.com).