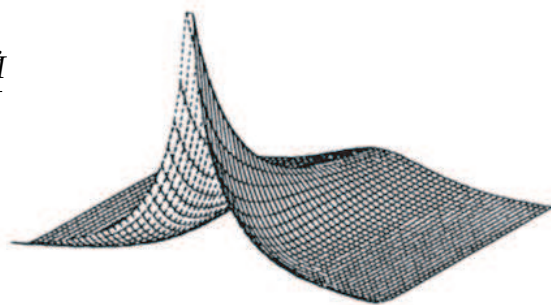




Кафедра ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель - академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

Заседание **18 апреля**. *Ломоносовские чтения*.

М. В. Болдин, Д. М. Есаулов (МГУ) *Локальная робастность GM-тестов в $AR(1)$ против выбросов*

В локальной схеме засорения авторегрессионных данных аддитивными н.о.р. выбросами устанавливаются условия качественной робастности GM-тестов против выбросов. Находятся асимптотически оптимальные робастные тесты.

А. П. Шашкин (МГУ) *Функциональные предельные теоремы для мер поверхностей уровня гауссовского случайного поля*

Рассматриваются меры множеств уровня гауссовского случайного поля с гладкими реализациями, рассматриваемого в некотором ограниченном окне наблюдения. Такие меры, индексированные точками уровня, определяют некоторый случайный процесс на вещественной прямой. Для последовательности окон наблюдения, растущих к бесконечности, при весьма общих требованиях к ковариационной функции поля доказана функциональная предельная теорема, устанавливающая сходимость упомянутых процессов в пространстве непрерывных функций к некоторому гауссовскому процессу. Ранее результаты о сходимости подобных процессов устанавливались лишь для конечномерных распределений или для сходимости по распределению в гильбертовом пространстве.

Семинар проводится по средам в аудитории 16-24

с 16:45 до 17:45

Координатором семинара на весенний семестр 2012 года назначен д.ф.-м.н., профессор Г. И. Фалин, ученым секретарем семинара - А. Абакирова (e-mail: abakirova@gmail.com).