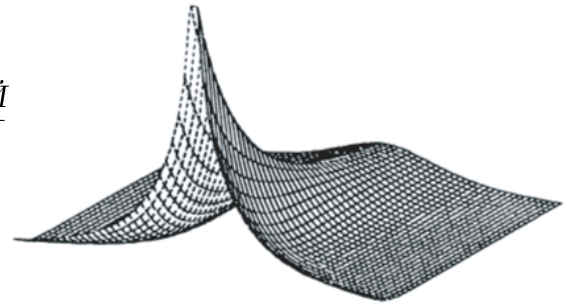




Кафедра ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ



## БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель - академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

**5 декабря — А.В. Лебедев**

*Многотипные максимальные ветвящиеся процессы и копулы экстремальных значений*

### **Резюме.**

Максимальные ветвящиеся процессы (МВП) были введены Дж. Ламперти (1970) как "экстремальные" аналоги процессов Гальтона-Ватсона (с заменой суммирования численностей потомков частиц на взятие максимума из них). Исследования этих процессов были продолжены автором в ряде работ (начиная с 2002). Было проведено обобщение МВП по области значений с  $Z^+$  на  $R^+$ , доказана эргодическая теорема и некоторые предельные теоремы для стационарных распределений.

2011 году автором были введены МВП с  $d > 2$  типами частиц и значениями в  $R_+^d$ . При некоторых дополнительных предположениях доказана эргодическая теорема в случае  $d = 2$ . В случае, когда распределения числа потомков имеют копулы экстремальных значений, теорема обобщается на любые  $d > 2$ . Доказаны предельные теоремы для стационарных распределений в случаях растущих прямоугольников и степенных хвостов. Результаты проиллюстрированы компьютерным моделированием.

**Семинар проводится по средам в аудитории 16-24**

**с 16:45 до 17:45**

Координатором семинара на осенний семестр 2012 года назначен к.ф.-м.н., доцент А.П. Шашкин (e-mail: ashashkin@hotmail.com), научным секретарем семинара - А.Ю. Хапланов (e-mail: KhaplanovA@gmail.com).