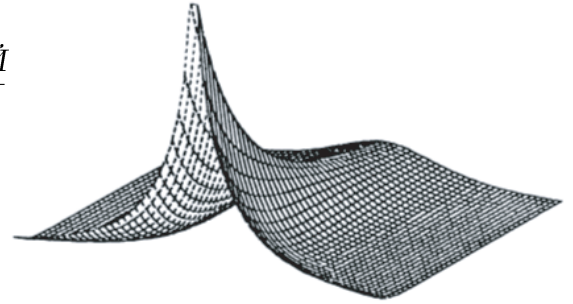




Кафедра ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель - академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

3 апреля — А.А. Наумов (МГУ)

Предельные теоремы для двух классов случайных матриц с зависимыми элементами.

Резюме.

В докладе будут рассмотрены случайные симметричные матрицы с зависимыми элементами. Предположим, что элементы матрицы имеют нулевое математическое ожидание и конечные дисперсии, которые могут быть различными числами. Предполагая выполнение условия Линдберга и сходимости нормированных сумм дисперсий в каждой строке и столбце к единице, мы доказываем, что ожидаемая эмпирическая спектральная функция распределения собственных значений матрицы сходится к полукруговому закону Вигнера. Результат может быть обобщен на класс ковариационных матриц с зависимыми элементами. В этом случае ожидаемая эмпирическая спектральная функция распределения сходится к закону Марченко-Пастура.

Доклад основан на совместных результатах Ф. Гётце, А.А. Наумова и А.Н. Тихомирова.

Семинар проводится по средам в аудитории 16-10

с 16:45 до 17:45

Координатором семинара на весенний семестр 2013 года назначен д.ф.-м.н., профессор С. А. Пирогов, ученым секретарем семинара – Р.Сверчков (e-mail: sverchkov.r@gmail.com).