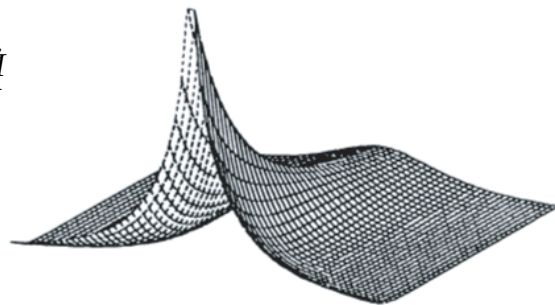




Кафедра ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

Заседание **18 сентября**. Предзащита аспирантов.

А. Воробьев

Об оптимальной остановке функционалов от несимметричного случайного блуждания и его максимума

В работе рассматриваются задачи оптимальной остановки для функционалов от несимметричного случайного блуждания и его максимума, которые при определенных условиях могут интерпретироваться как поиск оптимального момента для продажи или покупки акций в модели Кокса-Росса-Рубинштейна. Найдены новые условия, при которых оптимальный момент соответствует стратегии «Buy - and - hold».

Е. Кремена

О форме высоких выбросов гауссовских стационарных процессов

Мы исследуем форму выбросов гауссовских стационарных процессов, которые превышают высокий уровень u в одной или в двух различных точках. Нас интересует поведение траектории процесса после превышения высокого уровня. Такие траектории относительно слабо осциллируют вокруг ожидаемого значения. Найдена асимптотика вероятностей таких событий при $u \rightarrow \infty$.

А. Рубашный

Осредненное описание магнитного поля в задаче гидромагнитного динамо

Исследовано поведение среднего магнитного поля в различных задачах динамо. Выявлены отличия от классического случая и дополнительные ограничения для корреляционного тензора в случае отказа от евклидовости пространства, а также при переходе к случаю сложной топологии. Показан существенно более быстрый рост плотности магнитной энергии в пространстве Лобачевского. Обнаружено, что стандартные методы вывода уравнения среднего поля неэффективны в случае α -флуктуаций.

Семинар проводится по средам в аудитории 16-10
с 16:45 до 17:45

Координатором семинара на осенний семестр 2013 года назначен д.ф.-м.н.,
профессор В. Д. Конаков, ученым секретарем семинара — А. Макаров
(e-mail:artemmakarov@yandex.ru).