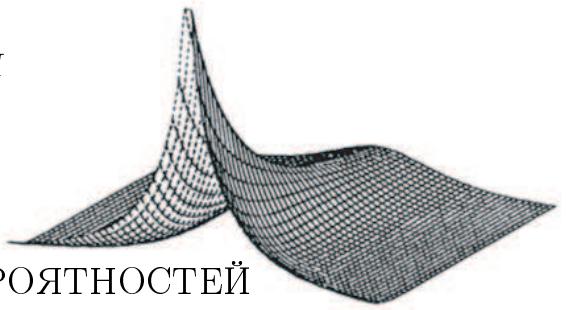




Кафедра ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

**23 декабря — Mikhail Menshikov (University of Durham)
2015 г.**

Explosion, implosion, and moments of passage times for continuous-time Markov chains: a semimartingale approach

We establish general theorems quantifying the notion of recurrence — through an estimation of the moments of passage times — for irreducible continuous-time Markov chains on countably infinite state spaces. Sharp conditions of occurrence of the phenomenon of explosion are also obtained. A new phenomenon of implosion is introduced and sharp conditions for its occurrence are proven.

Joint work with Dimitri Petritis (University of Rennes France)

Семинар проводится по средам в аудитории 12-24 Главного Здания
Московского Государственного Университета им. М.В. Ломоносова
с 16:45 до 17:45

Координатором семинара на осенний семестр 2015 года назначен
ассистент Каменов Андрей Александрович,
ученым секретарем семинара — Д.И. Лисовский