



## БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

30 марта — М.В. Житлухин (МИАН им. В.А. Стеклова)  
2016 г.

### *Некоторые оценки для максимума фрактального броуновского движения*

В докладе речь пойдет об оценках для математического ожидания максимума фрактального броуновского движения с параметром Харста  $H$  и его приближений процессами с дискретным временем. Основной результат состоит в том, что разность ожиданий для процесса с непрерывным временем и его приближения процессом с дискретным временем в  $n$  точках оценивается величиной порядка  $\sqrt{\log n}/n^H$ . Также будет дано простое доказательство того факта, что при  $H$  стремящемся к 0 математическое ожидание максимума фрактального броуновского движения можно оценить снизу и сверху величинами порядка  $1/\sqrt{H}$ .

**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 весенний семестр 2016 года назначена  
профессор Яровая Елена Борисовна,  
ученым секретарем семинара — А.И. Рытова