



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

13 апреля — В.И. Питербарг (МГУ им. М.В. Ломоносова)
2016 г.

Большие выбросы процессов гауссовского хаоса

Пусть имеется d -мерный гауссовский стационарный процесс $\xi(t)$ с независимыми компонентами и однородная функция $g : R^d \rightarrow R$ положительного индекса. В докладе рассматривается поведение распределения высоты больших выбросов процесса гауссовского хаоса $g(\xi(t))$. Важными примерами процессов гауссовского хаоса являются произведения гауссовских процессов и квадратичные формы от них. Используя результаты работ Д. Коршунова, Э.Хашорвы и докладчика для гауссовского хаоса, а также асимптотический метод двойных сумм, существенно модифицированный для рассматриваемой негауссовской модели случайного процесса, найдено точное асимптотическое поведение вероятностей высоких экстремумов траекторий процесса $g(\xi(t))$.

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