



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

15 февраля — А.А. Гуцин (МИАН, МГУ, ВШЭ; Москва)
2017 г.

Совместное распределение терминальных значений неотрицательного субмартингала и его компенсатора

Пусть X , $X_0 = 0$, — неотрицательный субмартингал класса (D) с разложением Дуба–Мейера $X = M + A$, где M — равномерно интегрируемый мартингал и A — интегрируемый предсказуемый возрастающий процесс (компенсатор субмартингала X). В докладе приводится характеристика возможных совместных распределений терминальных значений пары (X_∞, A_∞) . Оказывается, что то же самое множество возможных распределений имеет место и при дополнительных предположениях на субмартингал, например, что он является возрастающим процессом или квадратом мартингала. Особое внимание уделяется экстремальным (в определенном смысле) элементам этого множества двумерных распределений и описанию отвечающим им процессам. Мы также указываем на связь наших результатов с результатом Роджерса о характеристике возможных совместных распределений мартингала и его максимума.

**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 2017 года назначен
д. ф.-м. н. доцент Лебедев Алексей Викторович