



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

12 апреля — Д.П. Кожан (Сбербанк, Москва)
2017 г.

Асимптотическая мощность сверточных критериев симметрии и однородности. Финансовые приложения в задачах о «разладке»

Построены два новых критерия симметрии и три новых критерия однородности на основе распределений сверточных статистик. Сравнительно описаны их свойства. Определен стохастический интеграл от упреждающей функции. Для любых непрерывных альтернатив вычислены в явном виде характеристические функции мощности сверточных критериев симметрии на основе интеграла от упреждающей функции (свёртки второго типа) и на основе свёртки первого типа. Приведены приложения в финансовой математике (финансовые контрольные карты и задачи скорейшего обнаружения «разладки»). Все результаты являются новыми.

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