



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

19 апреля — В.И. Питербарг, А.И. Жданов (МГУ им. М.В.Ломоносова)
2017 г.

Большие выбросы процессов гауссовского хаоса. Аппроксимация в дискретном времени

Рассматривается гауссовский стационарный центрированный векторный процесс и однородная функция положительного порядка от данного процесса. Изучается асимптотическое поведение вероятности высокого выброса получившегося *процесса гауссовского хаоса*. Предлагаемая методология исследования включает в себя асимптотический метод Лапласа, асимптотический метод двойных сумм исследования гауссовских процессов, с применяемой впервые предварительной аппроксимацией процессов в непрерывном времени процессами с дискретным временем.

**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