



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

20 сентября – В.И. Питербарг (МГУ им. М.В.Ломоносова)
2017 г.

Массивные выбросы гауссовских случайных полей. Метод моментов.

Для гауссовских дважды п. н. непрерывно дифференцируемых гауссовских изотропных полей найдена асимптотика вероятности появления массивного выброса траектории за высокий уровень. Под массивным выбросом понимается выброс с диаметром основания, превосходящим фиксированное число. Для доказательства вводится и изучается точечный процесс выходов векторного гауссовского поля, компоненты которого являются копиями исходного поля, из расширяющегося множества.

Также получены общие результаты о логарифмической (грубой) асимптотике вероятностей высоких массивных выбросов.

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 осенний семестр 2017 года назначен
д. ф.-м. н. профессор Питербарг Владимир Ильич