



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

15 ноября — А.В. Лебедев (МГУ им. М. В. Ломоносова)
2017 г.

О взаимосвязи некоторых коэффициентов зависимости копул экстремальных значений

Для копул экстремальных значений с известным коэффициентом верхней хвостовой зависимости найдены поточечные верхние и нижние границы, которые используются для установления верхних и нижних границ коэффициентов корреляции Спирмена и Кендалла. Показано, что во всех случаях нижние границы достигаются на копулах Маршалла–Олкина, а верхние — на копулах с кусочно-линейными функциями зависимости.

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,
ученым секретарем семинара — И. А. Козик