



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

29 ноября – **Ю. Петрова** (Санкт-Петербургский государственный университет)
2017 г.

Точные асимптотики малых уклонений в L_2 -норме для конечномерных возмущений гауссовских процессов: спектральный подход.

В докладе рассматривается задача малых уклонений в L_2 -норме для некоторого семейства конечномерных возмущений гауссовских процессов. В “некритическом” случае выводится явное соотношение между точными асимптотиками вероятностей малых уклонений исходного и возмущенного процессов. В “критическом” случае, если возмущение достаточно “хорошее”, можно получить похожий результат; иначе - теоремы общего вида доказать не удаётся. Также будут рассмотрены примеры “критических” возмущений (процессы Дурбина, естественным образом возникающие в статистике). Для них общие теоремы не работают, но разработана техника, упрощающая вычисления в каждом конкретном случае.

**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