



## БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

21 марта – Е. В. Кремена (МГУ)  
2018 г.

### *Исследование формы высоких выбросов траекторий гауссовских процессов*

Рассматривается поведение траекторий стационарного гауссовского процесса, пересекших высокий уровень  $u$  в одной или в двух точках, отделенных друг от друга фиксированным положительным числом. В первой главе диссертации показано, что в случае простого выброса траектории процесса с подавляющей вероятностью остаются в относительно узкой (по сравнению с  $u$ ) полосе произвольно длительное время. Во второй главе аналогичный результат доказывается для массивных выбросов. В этом случае поведение вероятностей событий, связанных с высокими выбросами, зависит от того, в какой точке достигается максимальное значение ковариационной функции данного процесса на определенном отрезке. Рассматриваются оба возможных случая. Все результаты доказываются отдельно для дифференцируемых и недифференцируемых гауссовских процессов.

**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 2018 года назначен  
д. ф.-м. н. профессор Пирогов Сергей Анатольевич,  
ученым секретарем семинара — С.С. Лещенко