Εβδομαδιαίο Σεμινάριο

EXTREMES OF GAUSSIAN RANDOM FIELDS

Enkelejd Hashorva

University of Lausanne, Department of Actuarial Science

This talk is concerned with tail asymptotics of supremum of Gaussian random fields. Our findings extend the classical results for homogeneous Gaussian random fields and Gaussian random fields with unique maximum point of the variance. The applications that will be discussed include extremes of Shepp statistics, expansions for the tail probability of maximum loss and span of stationary Gaussian processes.

Δευτέρα 7 Νοεμβρίου 2016, ώρα 1:00μμ   Αίθουσα 201α Τμήματος Μαθηματικών

Μετά την ομιλία ακολουθεί καφές και συζήτηση στο εντευκτήριο του Τμήματος