

Аннотация лекции за 08.12.21.

Глава 5. Предельные теоремы для приращений случайных процессов.

§1. Универсальные предельные теоремы для процессов с независимыми приращениями.

Обсуждаются универсальные предельные теоремы для однородных процессов с независимыми приращениями. Показано, что результаты аналогичны результатам для сумм н.о.р.с.в. В качестве примеров рассматриваются винеровский процесс, устойчивые процессы со скачками одного знака, пуассоновский и сложный пуассоновский процессы. Предполагается, что $\xi(1)$ имеет односторонний экспоненциальный момент и принадлежит области нормального притяжения асимметричного устойчивого закона с показателем из $\alpha \in (1, 2]$. Обсуждаются обобщения на случай ненормального притяжения и менее жестких односторонних моментных условий. Обсуждается оптимальность моментных условий.