



Факультет математики и компьютерных наук
Санкт-Петербургский государственный университет

Совместный коллоквиум Математического института им. Л. Эйлера
и факультета МКН

18 апреля (четверг) в 17:30, ауд. 201, 14-я линия В.О., 29 + Zoom ID 812-916-426 (пароль стандартный)



А.Н. Тихомиров (НИУ ВШЭ)

"Метод Стейна и характеристические функции"

В 1972 году была опубликована работа Ч. Стейна "A bound for the error in the normal approximation to the distribution of sum of dependent random variables," с которой берет свое начало один из самых популярных методов оценки точности аппроксимации распределений в теории вероятностей и математической статистике. Ч. Стейн в своей статье высказывался о преимуществе прямых методов без использования аппарата характеристических функций. Однако, как показало время, во многих задачах аппарат характеристических функций весьма эффективен. Мы дадим краткое описание метода Стейна и приведем примеры возможного применения характеристических функций в методе Стейна.