

Случайные блуждания

Д.Н. Запорожец (ПОМИ РАН, Санкт-Петербург)

Случайное блуждание на прямой является одним из центральных понятий теории вероятностей. Несмотря на простоту его построения, оно является базовым примером для различных моделей как теоретического, так и прикладного характера.

Мы начнем с рассмотрения нескольких классических результатов чрезвычайно общего характера, в которых распределение шага блуждания играет лишь второстепенную роль. После этого мы обсудим, как данные результаты можно обобщить на многомерный случай.