

## ТОЧНАЯ АСИМПТОТИКА РАСПРЕДЕЛЕНИЯ МОМЕНТА ДОСТИЖЕНИЯ МАКСИМУМА ТРАЕКТОРИЕЙ ОБОБЩЕННОГО ПРОЦЕССА ПУАССОНА С ЛИНЕЙНЫМ СНОСОМ

*В. Е. Мосягин*

При определенных условиях на параметры  $a, p, q$  изучается функция распределения  $G(x)$  момента достижения максимума траекторией случайного процесса  $at - \nu_+(pt) + \nu_-(-qt)$ ,  $t \in (-\infty, \infty)$ , где  $\nu_-(t)$  и  $\nu_+(t)$  — независимые стандартные пуассоновские процессы при  $t \geq 0$  и равные нулю при  $t < 0$ . В работе найдена точная асимптотика хвостов распределения  $G(x)$ . Отмечается связь рассматриваемой задачи с задачей оценивания неизвестной точки разрыва плотности распределения по известной выборке.

*Ключевые слова и фразы:* пуассоновский процесс с линейным сносом, оценивание точки разрыва плотности распределения, точная асимптотика распределений.

*Мосягин Вячеслав Евгеньевич*  
Тюменский гос. университет,  
ул. Володарского, 6,  
Тюмень, 625003 РОССИЯ.  
E-mail: vmosyagin@mail.ru

Поступила в редакцию  
30 марта 2019 г.  
Получена после доработки  
21 апреля 2019 г.  
Принята к публикации  
10 июня 2019 г.