

Adam Jakubowski

Uniwersytet Mikołaja Kopernika

Zasada warunkowania po latach

Zasada warunkowania jest heurystyczną metodą konstrukcji twierdzeń granicznych dla zależnych zmiennych losowych z istniejących twierdzeń granicznych dla zmiennych niezależnych. Została ona sformułowana około 40 lat temu, a jej formalne uzasadnienie ukazało się w 1980 roku. Mimo, że zasada warunkowania i jej narzędzia wydają się powszechnie znane, w ostatnim okresie nie jest ona cytowana, a uzyskane wcześniej za jej pomocą rezultaty bywają odkrywane powtórnie. Co więcej, jej kluczowe narzędzia dowodowe nadal nie są stosowane w sposób wykorzystujący pełnię ich możliwości.

W trakcie referatu pokażemy, jak stosowane właściwie narzędzia związane z zasadą warunkowania pozwalają uzyskać istotne osłabienie założeń w twierdzeniach granicznych zawartych w pracach [1] i [2].

Bibliografia

- [1] M. Jara, T. Komorowski and S. Olla, Limit theorems for additive functionals of a Markov chain, *Ann. Appl. Probab.* 19 (2009), 2270–2300.
- [2] D. Surgailis, A quadratic ARCH(1) model with long memory and Lévy stable behavior of squares, *Adv. Appl. Probab.* 40 (2008), 1198–1222.