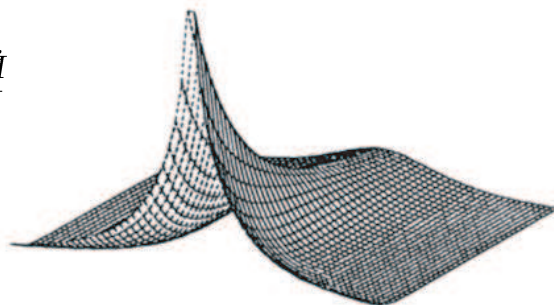




Кафедра ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

26 марта

— **А. А. Каменов** (Московский государственный университет)

Неаддитивные задачи об оптимальной остановке для стационарных диффузий (предзащита кандидатской диссертации)

Доклад посвящен решению задачи об оптимальной остановке процесса относительно его абсолютного максимума. Задачи такого типа возникают при поиске цены русского опциона, а также исследовании инвестиционных стратегий, в частности, "покупай и держи". Будет дан краткий обзор имеющихся результатов и представлено исследование, обобщающее их на случай произвольной стационарной диффузии, а также произвольной функции, оценивающей расстояние до максимума. В частности, показано, что в случае конечного временного горизонта задачу со свободной границей удаётся решить с использованием теорем, используемых в эконометрике.

Семинар проводится по средам в аудитории 12-24
с 16:45 до 17:45

Координатором семинара на весенний семестр 2014 года назначен д.ф.-м.н., профессор В. А. Малышев, ученым секретарем семинара — С. Музыка (e-mail:stepan.muzychka@yandex.ru).