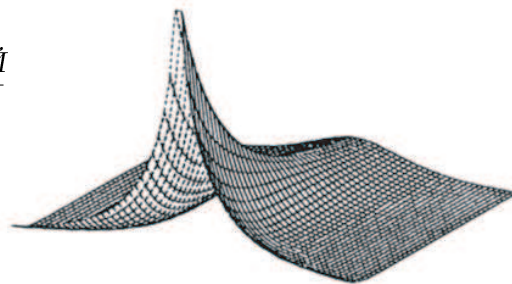




Кафедра ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

5 ноября 2014 – В. А. Каштанов (МИЭМ НИУ ВШЭ; МехМат МГУ)

*О структуре функционалов накопления, построенных
на траекториях управляемого полумарковского процесса
с конечным множеством состояний*

Для управляемого полумарковского процесса с конечным множеством состояний, имеющего несколько замкнутых классов сообщающихся состояний вложенной цепи Маркова, доказывается теорема о дробно-линейной зависимости функционала накопления от вероятностных мер, определяющих марковскую однородную рандомизированную стратегию.

Этот результат позволяет решать вопрос о структуре распределений, на которых достигаются экстремумы целевых функционалов.

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

Координатором семинара на осенний семестр 2014 года назначен
доцент Анатолий Дмитриевич Манита,
ученым секретарем семинара — В. Карпушин

<http://new.math.msu.su/department/probab/seminar.html> — наши объявления в PDF