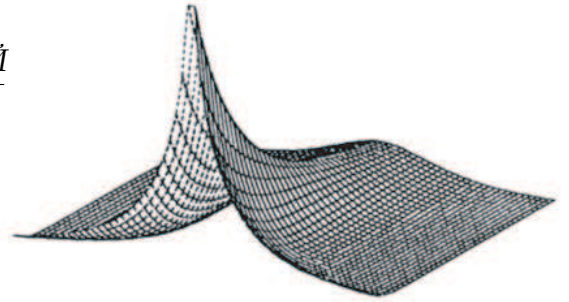




Кафедра ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель - член-корр. РАН, профессор А. Н. Ширяев

20 апреля — **А. Ю. Веретенников** (ИППИ)

Об уравнениях Маккина-Власова

(совместная работа с Ю.С. Мишурой, Киев)

Резюме.

В последние годы усилился интерес к исследованию уравнений Маккина-Власова, представляющих собой "усложненный вариант" стохастических дифференциальных уравнений Ито (СДУ). Усложнение состоит в том, что коэффициенты СДУ могут зависеть от маргинального распределения процесса. Мотивация состоит в том, что таким свойством обладают нестохастические уравнения плазмы, введенные Власовым; стохастический вариант был предложен Кацем и Маккином. Усилившийся интерес связан, с одной стороны, с недавними новыми результатами в этой области, а с другой - с осознанием того факта, что к уравнениям Маккина-Власова сводятся некоторые задачи и из других областей, в частности, из теории фильтрации.

Несмотря на все вышесказанное, даже условия существования и единственности решений до сих пор были известны лишь при определенных ограничениях, существенно более жестких, чем для уравнений Ито. Цель настоящей работы и доклада - дать более общие условия для существования и слабой и сильной единственности.

Семинар проводится по средам в аудитории 16-24

с 16:45 до 17:45