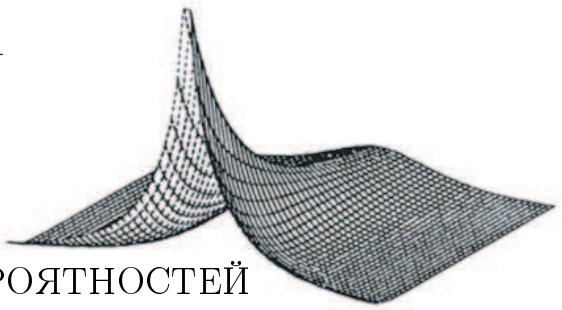




Кафедра ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ



## БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

18 ноября — Ю. В. Авербух (Институт математики и механики  
2015 г. им. Н. Н. Красовского УрО РАН)

### *Игровые задачи управления случайными процессами*

Доклад посвящен стохастическим играм с непрерывным временем, т. е. исследованию случайных процессов, динамика которых определяется решениями двух лиц (называемых игроками), имеющих противоположные интересы. Рассматриваемый в докладе класс задач включает в себя хорошо изученные стохастические дифференциальные игры, детерминированные дифференциальные игры и марковские игры с непрерывным временем (игровые задачи управления, в которых динамика определяется марковской цепью с непрерывным временем). Основной результат работы — аппроксимация функции гарантированного результата игрока решением стохастической игры с динамикой, отличной от динамики исходной системы. В качестве приложения рассматривается приближение решения детерминированной дифференциальной игры решением марковской игры.

Семинар проводится по средам в аудитории 12-24 Главного Здания Московского Государственного Университета им. М.В. Ломоносова  
с 16:45 до 17:45

Координатором семинара на осенний семестр 2015 года назначен  
ассистент Каменов Андрей Александрович,  
ученым секретарем семинара — Д.И. Лисовский