



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). Основным результатом 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