



## БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

18 мая — А.С. Братусь (МИИТ, совместитель МГУ (факультет ВМК))  
2016 г.

*Управление с обратной связью в стохастических задачах, содержащих ошибки управляющих воздействий в виде белого шума и их приложения к задачам механики и финансовой математики*

Рассматриваются задачи синтеза оптимального управления в стохастических системах с погрешностью выполнения управляющих воздействий в виде белого шума. Существенным отличием таких задач от детерминированных систем является появление областей, в которых реализуется сингулярное управление. В качестве приложений рассматриваются стохастические задачи коррекции движения и гашения колебаний, а так же стохастическая задача Мертона о выборе стратегии инвестирования.

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 весенний семестр 2016 года назначена  
профессор Яровая Елена Борисовна,  
ученым секретарем семинара — А.И. Рытова