



## БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

14 сентября — А.Ю. Веретенников (МГУ им. М.В. Ломоносова)  
2016 г.

### *Об одномерной эргодической управляемой диффузии*

Будет представлена совместная работа с С.Ануловой (ИПУ) и Х.Маем (Hilmar Mai, CREST, Paris), которую авторы надеются вскоре подготовить к печати. Для равномерно устойчивой управляемой диффузии с "усредненной по времени" функцией цены установлено "эргодическое уравнение Беллмана", доказана единственность его решения. Показано, что алгоритм последовательного улучшения стратегии приводит к сходимости к искомой цене.

Эргодическое управление приобрело популярность в последние годы. По сравнению с недавними результатами в этой области, в которых управляется лишь снос, мы разрешаем, чтобы от управления зависел и коэффициент диффузии.

**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 2016 года назначен  
д. ф.-м. н. Шабанов Дмитрий Александрович,  
ученым секретарем семинара — Д. А. Кравцов