



Кафедра ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

16 ноября — С.В. Шапошников (МГУ им. М.В. Ломоносова)
2016 г.

Оценки расстояний между переходными вероятностями диффузионных процессов и их приложения к нелинейным задачам

Будут представлены оценки расстояний по полной вариации и по метрике Канторовича между переходными вероятностями двух диффузионных процессов с различными матрицами диффузии и коэффициентами сноса. Планируется обсудить приложения таких оценок к нелинейным уравнениям Фоккера–Планка–Колмогорова, задачам оптимального управления, системам Mean Field Games.

**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