



## БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

20 февраля – Е.В. Богуславская (Brunel University, London)  
2019 г.

### *Интегральные преобразования Апеля и их применения, в том числе в многомерных проблемах оптимальной остановки*

Интегральное преобразование Апеля - это смесь интегрального экспоненциального преобразования типа Фурье или Лапласа с известным в финансовой математике (особенно страховании) преобразованием Эшера. Полученное новое преобразование обладает многими замечательными свойствами, в том числе с его помощью легко строить мартингалы от процессов Леви. В данном докладе мы подробно рассмотрим его применения к задачам многомерной оптимальной остановки. Особенное внимание мы уделим задачам, в которых функция выгоды является многомерным полиномом.

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 2019 года назначен  
профессор Дмитрий Дмитриевич Соколов