Math-Net.Ru

Общероссийский математический портал

А. Н. Ширяев, В. В. Мазалов, Международная конференция “Стохастическая теория оптимальной остановки”, *Теория вероятн. и ее примен.*, 2010, том 55, выпуск 4, 823–824

DOI: <https://doi.org/10.4213/tvp4289>

Использование Общероссийского математического портала Math-Net.Ru подразумевает, что вы прочитали и согласны с пользовательским соглашением

<http://www.mathnet.ru/rus/agreement>

Параметры загрузки:

IP: 54.81.137.203

26 апреля 2023 г., 16:23:40

приняли участие 210 участников из 29 стран: Украины, России, Беларуси, Молдовы, Азербайджана, Грузии, Узбекистана, Литвы, Франции, Великобритании, Румынии, Болгарии, Венгрии, Польши, Хорватии, Чехии, Германии, Финляндии, Швеции, Швейцарии, Италии, Испании, Португалии, Греции, Турции, Алжира, США, Канады, Японии.

Научная программа конференции состояла из пленарных и секционных докладов. С пленарными докладами выступили В. Анисимов (Великобритания), С. Е. Ахмед (Канада), А. Булинский (Россия), Э. Валкейла (Финляндия), А. Веретенников (Великобритания), М. Гротхаус (Германия), А. Гуцин (Россия), А. Дороговцев (Украина), М. Доцци (Франция), П. Духан (Франция), К.-Х. Индлекофер (Германия), Дж. Йин (США), К. Канатани (Япония), И. Катаи (Венгрия), И. Коваленко (Украина), Ю. Кондратьев (Германия), В. Королюк (Украина), К. Кубилос (Литва), Н. Леоненко (Великобритания), Н. Лимниос (Франция), Л. Маттнер (Германия), А. Милле (Франция), И. Молчанов (Швейцария), А. Нойенкирх (Германия), Э. Орзингер (Италия), М. Рёкнер (Германия), М. Д. Руиз Медина (Испания), Д. Сильвестров (Швеция), У. Штадтмюллер (Германия).

Культурную программу конференции составили вечер воспоминаний, экскурсионная прогулка по Днепру и запомнившийся всем участникам концерт Народного ансамбля украинской музыки «Роксолания», созданного при Институте филологии Киевского национального университета имени Тараса Шевченко.

С материалами конференции можно ознакомиться на сайте <http://probability.univ.kiev.ua/msta2conf/>.

Ю. С. Мишура, А. А. Гуцин

МЕЖДУНАРОДНАЯ КОНФЕРЕНЦИЯ «СТОХАСТИЧЕСКАЯ ТЕОРИЯ ОПТИМАЛЬНОЙ ОСТАНОВКИ»

С 12 по 16 сентября 2010 г. в Карелии в 35 километрах от г. Петрозаводска на берегу Укшозера состоялась очередная международная конференция по теории оптимальной остановки.

Конференция была организована Институтом прикладных математических исследований Карельского научного центра РАН и Математическим институтом им. В. В. Стеклова РАН при поддержке Российского фонда фундаментальных исследований РАН и Президиума Российской академии наук.

Данная конференция продолжает серию конференций по оптимальной остановке. Первая из них «Strategies for sequential search and selection in real time», близкая к данной тематике, проходила в США (Амхерст) в 1990 г. Затем состоялись конференции по оптимальной остановке в Японии (Нагойя) в 1994 г., Польше (Бедлево) в 2002 г., России (Петрозаводск) в 2005 г., Великобритании (Манчестер) в 2007 г. и Финляндии (Турку) в 2009 г. Наконец, настоящая конференция в Петрозаводске была седьмой в данном направлении.

В программный комитет вошли:

от России: чл.-корр РАН А. Н. Ширяев (председатель программного комитета, МИАН, Москва), В. В. Мазалов (ИПМИ КарНЦ РАН, Петрозаводск);

от Германии: A. Irle (University of Kiel), H.-J. Engelbert (University of Jena), H. R. Lerche (University of Freiburg);

от США: L. Shepp (Rutgers University, New Jersey);

от Японии: M. Yamaki (Aichi University), M. Yasuda (Chiba University);

от Польши: K. Szajowski (Institute of Mathematics, Wrocław University of Technology, Wrocław);

от Великобритании: G. Peskir (University of Manchester);

от Норвегии: В. Øksendal (Center of Mathematics for Applications, Department of Mathematics, University of Oslo);

от Франции: E. Altman (INRIA);

от Финляндии: P. Salminen (Abo Akademi University).

В конференции приняли участие ученые из России, Германии, Японии, США, Польши, Великобритании, Китая и др. К началу конференции были изданы расширенные тезисы докладов.

Тематика данной конференции была посвящена обсуждению новых результатов в области теории оптимальной остановки и стохастического управления. При этом работа велась по секциям:

- оптимальная остановка; общая теория;
- правила многократной остановки и оптимальная остановка пространственных процессов;
- задача наилучшего выбора и их обобщения, задача о парковке, задача поиска работы;
- задачи оптимальной остановки с ограничениями;
- задача о разладке;
- стохастические и сетевые игры;
- оптимальная остановка и американские опционы;
- методы математического программирования в задачах оптимальной остановки.

Значительное внимание на конференции было уделено управляемым случайным процессам и их приложениям в задачах наилучшего выбора, финансовой и страховой математики, обнаружения изменения свойств процессов и др. Были предложены новые постановки задач оптимальной остановки, в том числе модели скорейшего обнаружения изменения свойств случайного процесса, в которых стохастический дифференциал содержит функцию управления (А. Н. Ширяев, Р. Даланг), многомерный вариант задачи оптимальной остановки, который трактуется как модель американского опциона с гарантией (Ф. Ирле, С. Кристенсен).

Большой интерес на конференции вызвали доклады, посвященные новым приложениям стохастического анализа в задачах инвестиций в страховую пенсионный фонд (Л. Шепп), оптимальному поведению на рынке ценных бумаг (В. К. Доманский, В. Л. Крепс, Р. В. Иванов), скорейшему обнаружению опухолей в медицинской диагностике (В. Г. Бурмистрова, А. А. Бутов, К. О. Раводин). Построению эффективных алгоритмов нахождения оптимальных правил остановки были посвящены доклады Э. Л. Пресмана, К. Шаевского, К. Ано, теоретико-игровым моделям — доклады В. В. Мазалова, А. А. Ивашко, Е. Н. Шевкопляс, И. А. Чернова.

Был представлен ряд работ, связанных с нахождением решений в задачах предсказания значений случайной последовательности (Г. Р. Лерхе) и наилучшего выбора для наблюдаемых процессов с неизвестными параметрами (А. В. Колногоров, А. С. Тихомиров, Т. Н. Шелонина), а также стохастическим моделированием интернет-графов (Ю. Л. Павлов и М. М. Лери). Наряду с работами известных ученых на конференции было представлено большое количество докладов молодых участников (С. Ш. Кумачева, Е. С. Берникович, Н. В. Плаксина и др.).

По результатам работы симпозиума принято решение подготовить Труды конференции и издать их в журнале «Обозрение прикладной и промышленной математики».

С информацией о проведении конференции можно ознакомиться на сайте Карельского научного центра РАН: <http://mathem/krc/karelia/ru/event.php?id=132&plang=r>.

А. Н. Ширяев, В. В. Мазалов