Спецсеминар

Стохастический и функциональный анализ в вероятности, математической статистике и финансовой математике

Руководители:
Альберт Николаевич Ширяев
Александр Александрович Гущин

В теории вероятностей и математической статистике успехи последних лет связаны с широким использованием методов стохастического анализа. Стохастический анализ пронизывает те разделы и задачи, где изучается потраекторное поведение динамических систем. Примером применения методов функционального анализа являются проблемы оптимального инвестирования в финансовой математике и минимаксные теоремы в математической статистике.