СТОХАСТИЧЕСКИЙ И ФУНКЦИОНАЛЬНЫЙ АНАЛИЗ В ВЕРОЯТНОСТИ, МАТЕМАТИЧЕСКОЙ СТАТИСТИКЕ И ФИНАНСОВОЙ МАТЕМАТИКЕ

Руководители семинара: академик А. Н. Ширяев, д.ф.-м.н. А. А. Гущин

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