

## Семинар 21 сентября

?????????? ?????? ????????? ????????? «????????????? ??????? ?????????????? ?????????» ??? ????????????????? ??????????? ? . ? . ??????????????

???????????? ?????????? ?????????? ? ?????????? 21 ?????????? ? 16<sup>20</sup>, ????. 504.

? ?????????? ?? ????? "Аппроксимация дифференциальной игры марковскими играми" ?????????? ?????????? ?????????? сотрудник ИММ УрО РАН (г. Екатеринбург), к.ф.-м.н. **Авербух Ю.В.**

### Аннотация доклада.

Доклад посвящен построению приближенно оптимальных стратегий в дифференциальных играх. В работах Н.Н. Красовского и А.Н. Котельниковой была предложена процедура управления со стохастическим поводырем. В этих работах движение моделирующей системы (поводыря) описывалось стохастическим дифференциальным уравнением. Такая схема управления позволяет построить почти оптимальную стохастическую стратегию на основе решения параболического уравнения в частных производных с малым коэффициентом при лапласиане. В докладе схема управления со стохастическим поводырем переносится на случай, когда движение моделирующей системы описывается марковской цепью с непрерывным временем, аппроксимирующей исходную детерминированную управляемую систему. Этот метод управления позволяет построить приближенно оптимальные стохастические стратегии в дифференциальной игре на основе решения системы обыкновенных дифференциальных уравнений.

**Source URL:** <http://sa.cs.msu.su/node/351>