



SCUOLA
NORMALE
SUPERIORE

NO FREE LUNCH SEMINAR

seminari di finanza quantitativa

martedì 15 marzo 2011

ore 13.00

Scuola Normale Superiore

Pisa

(Aula Bianchi)

Salvatore FEDERICO

Università Parigi VII e Alma Research

Terrà un seminario dal titolo:

“Rappresentazione a dimensione infinita per problemi di controllo con ritardo”

Abstract

I problemi di controllo con ritardo nella variabile di stato e/o di controllo emergono in maniera naturale in molti contesti applicativi (Fisica, Biologia, Economia, ecc.). La prima parte del seminario sarà dedicata all'illustrazione di una serie di esempi di interesse in ambito economico-finanziario. La seconda parte del seminario sarà dedicata alla descrizione delle difficoltà matematiche a cui bisogna far fronte nell'affrontare tali problemi ed alla descrizione dell'approccio di rappresentazione a dimensione infinita agli stessi. Infine l'ultima parte sarà dedicata allo studio di alcuni problemi specifici e all'illustrazione di alcuni risultati di regolarità per le equazioni di Hamilton-Jacobi-Bellman associate.

Tutti gli interessati sono invitati a partecipare.

Classe di Scienze