



УПРАВЛЯЕМЫЙ СЛУЧАЙНЫЙ ПРОЦЕСС

УПРАВЛЯЕМЫЙ СЛУЧАЙНЫЙ ПРОЦЕСС, случайный процесс, вероятностные характеристики которого могут изменяться по ходу наблюдений в зависимости от поставленной цели, заключающейся в максимизации (минимизации) того или иного функционала, определяющего качество управления. Различают разл. виды У. с. п. как по способу их задания и описания, так и по типу целей управления. Одним из стимулов изучения У. с. п. явилось развитие методов [*последовательного анализа*](#).

Литература

Лит.: Гихман И. И., Скороход А. В. Управляемые случайные процессы. К., 1977.