

П  
ТЗЗ

ISSN 0040 – 361X

РОССИЙСКАЯ АКАДЕМИЯ НАУК

ТЕОРИЯ  
ВЕРОЯТНОСТЕЙ  
И ЕЕ ПРИМЕНЕНИЯ

Журнал имени А.Н.Колмогорова

ТОМ 58  
ВЫПУСК  
1



«НАУКА»

2013

СОДЕРЖАНИЕ

К столетию со дня рождения Б. В. Гнеденко . . . . .	3
<i>Коваленко И. Н.</i> О жизни и трудах Бориса Владимировича Гнеденко . . . . .	7
<i>Bingham N. H.</i> The worldwide influence of the work of B. V. Gnedenko . . . . .	27
<i>Боровков А. А., Могульский А. А.</i> Принципы больших уклонений для траекторий случайных блужданий. III . . . . .	37
<i>Клебанер Ф., Липцер Р.</i> Когда стохастическая экспонента является мартингалом. Развитие метода Бенеша . . . . .	53
<i>Козлов М. В.</i> О больших уклонениях максимума крамеровского случайного блуждания и процесса ожидания . . . . .	81
<i>Королев В. Ю.</i> Обобщенные гиперболические распределения как предельные для случайных сумм . . . . .	117
<i>Розовский Л. В.</i> О малых уклонениях рядов независимых неотрицательных случайных величин с гладкими весами . . . . .	133
<i>Шевцова И. Г.</i> О точности нормальной аппроксимации для обобщенных пуассоновских распределений . . . . .	152
<i>Pancheva E. I.</i> Asymptotic behavior of central order statistics under monotone normalization . . . . .	177

Краткие сообщения

<i>Житлухин М. В., Ширяев А. Н.</i> Задачи об оптимальной остановке для броуновского движения с разладкой на отрезке . . . . .	193
<i>Шур М. Г.</i> Две теоремы о параметре сходимости для неприводимой марковской цепи . . . . .	200

Информация о научной жизни

Международная конференция «Современная стохастика: теория и применения III» . . . . .	206
---	-----

C O N T E N T S

To the centenary of the birth of B. V. Gnedenko . . . . .	3
<i>Kovalenko I. N.</i> About the life and works of Boris Vladimirovich Gnedenko . . . . .	7
<i>Bingham N. H.</i> The worldwide influence of the work of B. V. Gnedenko . . . . .	27
<i>Borovkov A. A., Mogulskii A. A.</i> On large deviation principles for random walk trajectories. III . . . . .	37
<i>Klebaner F., Liptser R.</i> When a stochastic exponential is a true martingale. Extension of a method of Benes . . . . .	53
<i>Kozlov M. V.</i> On large deviation of the maximum of Cramer random walk and waiting process . . . . .	81
<i>Korolev V. Yu.</i> Generalized hyperbolic distributions as limit distributions for random sums . . . . .	117
<i>Rozovskii L. V.</i> On small deviations of series of independent random variables with smooth weights . . . . .	133
<i>Shevtsova I. G.</i> On exactness of normal approximation for generalized Poisson distributions . . . . .	152
<i>Pancheva E. I.</i> Asymptotic behavior of central order statistics under monotone normalization . . . . .	177

Short Communications

<i>Zhitlukhin M. V., Shiryayev A. N.</i> Optimal stopping problems for Brownian motion with disorder on a bounded interval . . . . .	193
<i>Shur M. G.</i> Two theorems on convergence parameter for irreducible Markov chain . . . . .	200

News of Scientific Life

International conference «Modern Stochastics: Theory and Applications III» . . . . .	206
--	-----

Редакционная подготовка и изготовление тиража выполнены  
ООО «Редакция журнала «Обозрение прикладной и промышленной математики»» и  
ООО «Редакция журнала «Теория вероятностей и ее применения»»  
Технический редактор Д. К. Никафев

---

Лицензия № ЛР-061510 от 08.09.97  
Сдано в набор 02.10.2012. Подписано к печати 20.11.2012. Формат бумаги 70 × 100 1/16.  
Офсетная печать. Усл. печ. л. 18,2. Уч.-изд. л. 20,7. Бум. л. 6,5.  
Тираж 320 экз. Зак. 4205. Свободная цена.

---

Адрес редакции: 119991 Москва, ГСП-1, ул. Губкина, 8, тел. 8-499-135-23-80.  
Цифровая типография ООО «Буки Веди»:  
105066, Москва, ул. Новорязанская, д. 38, стр. 1, пом. IV. тел.: 495 926 6396.