

2016, том 61, выпуск 1

-
- Современные проблемы финансовой математики 3
Ю. М. Кабанов, А. Н. Ширяев
 - Аналитическая аппроксимация плавающих рент для 5
малой волатильности и малой выплаты
Т. Бен Зинеб, Э. Гобе
 - Максимизация ожидаемой полезности для 26
экспоненциальных моделей Леви с опционом и
информационные процессы
Л. Ю. Вострикова
 - Оценивание опционов азиатского и баскетного типов с 53
помощью верхних и нижних границ
А. А. Новиков, С. Александер, Н. Е. Кордзахия, Т. Линг
 - Явное описание функций полезности типа HARA и 69
отвечающих им оптимальных портфелей
Т. Чоулли, Д. Ма
 - New developments on the Modigliani–Miller theorem 114
S. Aboura, E. Lepinette
 - Brownian bridges on random intervals 129
M. L. Bedini, R. Buckdahn, H.-J. Engelbert

Краткие сообщения

- Об одном интегральном представлении броуновского 158
функционала
О. А. Глонти, О. Г. Пуртухия
- Стратегии, связанные с моментом инвестирования и 165
размером вкладываемой суммы, в условиях
асимметричной информации
К. Куи, Т. Шибата
- О существовании мартингалльных мер, 173
удовлетворяющих ослабленному условию
несовпадения барицентров, в случае счетного
вероятностного пространства
И. В. Павлов, В. В. Шамраева, И. В. Цветкова
- On an optimal stopping problem of an insider 181
E. Bayraktar, Zh. Zhou
- First passage problems over increasing boundaries for Lévy 186
processes with exponentially decayed Lévy measures
Sh. Kaji
- Maximal exponential inequalities for certain diffusion 198
processes
C. Makasu

