

| Содержание |

Стохастическое исчисление, мартингалы и их применения

Сборник статей. К 80-летию со дня рождения академика Альберта Николаевича Ширяева

- Адрес МИАН Альберту Николаевичу Ширяеву к его 80-летию 7
- О некоторых функциональных неравенствах для скошенного броуновского движения 9
А. Т. Абакирова
- The stochastic field of aggregate utilities and its saddle conjugate 21
P. Bank, D. Kramkov
- Новый подход к проблеме сегментации временных рядов произвольной природы 61
Б. С. Дарховский, А. Пирятинская
- Utility maximisation and utility indifference price for exponential semi-martingale models and HARA utilities 75
A. Ellanskaya, L. Vostrikova
- Convergence of probability measures and Markov decision models with incomplete information 103
Eugene A. Feinberg, Pavlo O. Kasyanov, Michael Z. Zgurovsky
- О потраекторных аналогах максимальных неравенств Дуба 125
А. А. Гуцин
- On the submartingale/supermartingale property of diffusions in natural scale 129
Alexander Gushchin, Mikhail Urusov, Mihail Zervos
- Аппроксимация решения обратного стохастического дифференциального уравнения. Случай малого шума, большой выборки и высокочастотных наблюдений 140
Ю. А. Кутоянц
- О точных максимальных неравенствах для случайных процессов 162
Я. А. Люлько, А. Н. Ширяев
- Многомерные и абстрактные вероятности 182
В. М. Максимов
- Задача о двусторонней разладке для броуновского движения в байесовской постановке 211
А. А. Муравлёв, А. Н. Ширяев

● Нижние и верхние оценки для цен опционов азиатского типа А. А. Новиков, Н. Е. Кордзахия	234
● Критическая размерность в семипараметрической теореме Бернштейна–фон Мизеса М. Е. Панов, В. Г. Спокойный	242
● Характеризация процессов плотностей деформированных стохастических базисов первого рода И. В. Павлов, О. В. Назарько	267
● Nearly optimal sequential tests of composite hypotheses revisited Alexander G. Tartakovsky	279
● К закону больших чисел для мартингалов П. А. Яськов	300
● О существовании решений неограниченных задач об оптимальной остановке М. В. Житлухин, А. Н. Ширяев	310