

ВВЕДЕНИЕ В ТЕОРИЮ МАРТИНГАЛОВ

к.ф.-м.н. М.В. Житлухин

Мартингалом называется случайная последовательность (или процесс), которая в будущем остается постоянной в среднем. Мартингалы находят широкое применение в теории вероятностей и, в особенности, в стохастическом исчислении, а также различных приложениях, например, в финансовой математике. Цель этого курса — познакомить слушателей с основными понятиями и результатами теории мартингалов: определениями и базовыми свойствами, теоремами о сходимости, мартингальными неравенствами, связью мартингалов и последовательностей плотностей вероятностных мер. Все изложение будет вестись для случая дискретного времени. Для понимания курса достаточно знать стандартный курс теории вероятностей.