

СО Д Е Р Ж А Н И Е

Ширяев А. Н. О стохастических моделях и оптимальных методах в задачах скорейшего обнаружения 417

ДИСКРЕТНОЕ ВРЕМЯ

Боровков А. А. Оценки момента разладки по большим выборкам при неизвестных распределениях 437

Новиков А. А. Несколько замечаний о распределении времени первого выхода и оптимальной остановке AR(1)-последовательностей 458

Тартаковский А. Г. Асимптотическая оптимальность в байесовских задачах наискорейшего обнаружения при ограничении на глобальную вероятность ложной тревоги 472

Pollak M., Tartakovsky A. G. Asymptotic exponentiality of the distribution of first exit times for a class of Markov processes with applications to quickest change detection 500

НЕПРЕРЫВНОЕ ВРЕМЯ

Аркин В. И., Слостников А. Д. Вариационный подход к задачам оптимальной остановки диффузионных процессов 516

Бурнаев Е. В. О задаче обнаружения разладки для пуассоновского процесса в обобщенной байесовской постановке 534

Бурнаев Е. В., Файнберг Е. А., Ширяев А. Н. Об асимптотической оптимальности второго порядка в минимаксной задаче скорейшего обнаружения момента изменения сноса у броуновского движения 557

Каменов А. А. Башелье-версия русского опциона на конечном интервале 576

Baurdoux E. J., Kyprianou A. E. The Shepp-Shiryayev stochastic game driven by a spectrally negative Lévy process 588

Hadjiladis O., Poor H. V. On the best 2-CUSUM stopping rule for quickest detection of two-sided alternatives in a Brownian motion model 610

Peskir G. Optimal stopping games and Nash equilibrium 623