

СОДЕРЖАНИЕ

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

Краткие сообщения

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