

Это некоторая информация по спецкурсу. Итак, мы зафиксировали время: лекция – понедельник 16-45 ауд. 16-01, семинар – понедельник 18-30 (с небольшим опозданием на переход из ГЗ) ауд. Лаб. корпус А (см. номер 40 на карте <http://www.msu.ru/info/lengory.html>). Я все еще не вспомнил номер аудитории, но это на первом этаже, от вахты налево и вдоль коридора примерно третья по счету дверь ( $\pm 1$ ). Новый список отослан.

Первый семинар на следующей неделе. Будет рассмотрен вариант построения винеровского процесса из книги "Теория вероятностей 3", ВИНТИ, Итоги науки и техники, Современные проблемы математики, Фундаментальные направления, том 45 Стохастическое исчисление. ред. Гамкрелидзе Р.В., ред.-составителя Прохоров Ю.В. и Ширяев А.Н., глава 1, параграф 1. Книга в переводе на английский (если так ее легче найти в электронном виде) называется не так, как я думал: см.

<http://www.amazon.com/Probability-Theory-III-Stochastic-ebook/dp/B000VI07WM>

Другой вариант той же ссылки (на английском): *http : //www.mathnet.ru/php/archive.phtml?wshow = paper&jrnid = intf&paperid = 142&option\_lang = eng*

Следующая тема, которую я бы предложил подготовить кому-либо с 3-4 курса: принцип отражения Андре и распределение максимума винеровского процесса (ВП) из того же параграфа. Хорошо бы тоже приготовить это к ближайшему понедельнику, хотя бы дискретный вариант принципа отражения. Следующая тема к семинару (скорее всего – еще через неделю) – параграф 2 из той же книги (по крайней мере, первая страница параграфа) – про связь ВП с уравнением Лапласа, но без формулы Ито (которая будет впереди).

На лекции я намерен закончить про ВП и начать стохастический интеграл по ВП. А затем уже начнутся стохастические дифференциальные уравнения.

А.Ю.В.