

**ПОСТРОЕНИЕ КРАТНЫХ СТОХАСТИЧЕСКИХ  
ИНТЕГРАЛОВ ПО НЕГАУССОВЫМ  
ПРОДАКТ-МЕРАМ***И. С. Борисов, С. Е. Хрущев*

В работе предлагается конструкция стохастического интеграла от неслучайной функции по интегрирующим процессам, допускающим представление в виде ортогональных рядов. Предложенная модель сравнивается с более традиционными схемами построения подобных интегралов.

*Ключевые слова и фразы:* кратный стохастический интеграл, кратный ортогональный ряд, гильбертов случайный процесс, разложение случайного процесса в ортогональный ряд.

*Борисов Игорь Семенович*

Институт математики  
им. С. Л. Соболева СО РАН,  
просп. Академика Коптюга, 4,  
Новосибирск, 630090 РОССИЯ.  
Новосибирский гос. университет,  
ул. Пирогова, 2,  
Новосибирск, 630090 РОССИЯ.  
E-mail: sibam@math.nsc.ru

Статья поступила  
3 июня 2012 г.

*Хрущев Сергей Евгеньевич*

аспирант ИМ СО РАН,  
просп. Академика Коптюга, 4,  
Новосибирск, 630090 РОССИЯ.  
E-mail: hrushew@rambler.ru