

«ПРЯМОЙ» МЕТОД ДОКАЗАТЕЛЬСТВА ОБОБЩЕННОЙ ФОРМУЛЫ ИТО — ВЕНТЦЕЛЯ ДЛЯ ОБОБЩЕННОГО СТОХАСТИЧЕСКОГО ДИФФЕРЕНЦИАЛЬНОГО УРАВНЕНИЯ

Е. В. Карачанская

Впервые представлено полное, с точки зрения стохастического анализа, доказательство обобщенной формулы Ито — Вентцеля, идеи которого изложены в [1]. Данное доказательство представляет подход к построению обобщенной формулы Ито — Вентцеля, который базируется на непосредственном привлечении обобщенной формулы Ито и теории стохастической аппроксимации, в отличие от представленного в [2], основанного на методе интегральных инвариантов стохастического дифференциального уравнения.

Ключевые слова и фразы: формула Ито — Вентцеля, обобщенное уравнение Ито, пуассоновская мера, δ -последовательность, сходимость в среднем квадратическом.

Список литературы

1. Дубко В. А., Карачанская Е. В. *О двух подходах к построению обобщенной формулы Ито — Вентцеля* / Препринт № 174. Вычислительный центр ДВО РАН. Хабаровск: Изд-во Тихоокеан. гос. ун-та, 2012.
2. Карачанская Е. В. Обобщенная формула Ито — Вентцеля для случая нецентрированной пуассоновской меры, стохастический первый интеграл и первый интеграл // *Матем. тр.* 2014. Т. 17, № 1. С. 99–122.

Карачанская Елена Викторовна
Тихоокеанский госуниверситет,
ул. Тихоокеанская, 136,
Хабаровск, 680035 РОССИЯ.
E-mail: EKarachanskaya@mail.khstu.ru

Статья поступила
30 апреля 2014 г.