**Кабанов, Юрий Михайлович.**

## Мартингальные методы в теории считающих процессов : диссертация ... доктора физико-математических наук : 01.01.05. - Москва, 1982. - 297 с. : ил.

## Оглавление диссертациидоктор физико-математических наук Кабанов, Юрий Михайлович

Введение.

Глава I. Считающие процессы и компенсаторы

§ 0. Сведения из общей теории процессов

§ I. Основные определения и свойства.

§ 2. Пространство траекторий считающих процессов.

§ 3. Задание распределений считающих процессов при помощи компенсаторов.

Глава 2. Абсолютная непрерывность распределений считающих процессов.

§ I. Локальное разложение Лебега вероятностных

§ 2. О множествах сходимости семимартингалов.

§ 3. Компенсаторы и локально абсолютно непрерывная замена меры.

§ Критерий равномерной интегрируемости и сингулярности распределений считающих процессов

§ 5. Примеры применения критерия абсолютной непрерывности распределений считающих процессов

Глава 3. Предельные теоремы для считающих процессов

§ I. Сходимость конечномерных распределений

§ 2. Скорость сходимости к считающим процессам с независимыми приращениями

§ 3. Слабая сходимость распределений в пространстве

Скорохода.

§ Сильная сходимость распределений считающих процессов

§ 5. Примеры

Глава Некоторые задачи управления, связанные со считающими процессами.ЗР.З

§ I, Теорема существования в задаче управления локальной плотностью .Д

§ 2. Пропускная способность канала пуассоновского типа .Л1.

§ 3. Об уравнении Беллмана для управляемых дифференциальных уравнений, возмущаемых процессом пуассоновского типа с управляемой интенсивностью.

§ Принцип максимума Понтрягина для линейных дифференциальных уравнений, возмущаемых процессом пуассоновского типа.

Глава 5.' Абсолютная непрерывность и сингулярность локально абсолютно непрерывных вероятностных распределений.246.

§ I. "Предсказуемый?1 критерий абсолютной непрерывности вероятностных мер.

§ 2. Достаточное условие равномерной интегрируемости одного класса неотрицательных мартингалов

§ 3. Мульти^вариантные точечные процессы, последовательности случайных величин.

§ Процессы с независимыми приращениями.

§ 5. Семимартингалы.2?