Math-Net.Ru

Общероссийский математический портал

М. Жанблан-Пике, А. Н. Ширяев, Памяти Марка Йора, *Теория вероятн. и ее примен.*, 2014, том 59, выпуск 1, 205–206

DOI: <https://doi.org/10.4213/tvp4561>

Использование Общероссийского математического портала Math-Net.Ru подразумевает, что вы прочитали и согласны с пользовательским соглашением
<http://www.mathnet.ru/rus/agreement>

Параметры загрузки:

IP: 18.207.199.55

26 апреля 2023 г., 15:32:58

© 2014 г.

Памяти Марка Йора

9 января 2014 года ушел из жизни член Редакционного совета нашего журнала Марк Йор.

Марк Йор родился 24 июля 1949 г. После учебы в 1969–1973 гг. в Высшей нормальной школе Кашана (Ecole Normale Supérieure de Cachan) он поступил на работу в Национальный центр научных исследований (CNRS), а кроме того, с 1981 г. и до ухода на пенсию 1 января 2014 г., работал профессором в Университете Пьера и Мари Кюри (Paris 6).

Марк Йор был членом Академии наук по секции математики и членом Institut Universitaire de France; получил несколько наград, включая Гумбольдтовскую и Монтионовскую премии, и был награжден орденом «За заслуги» (Ordre National du Mérite) Французской Республики.

В 1976 г. он защитил PhD диссертацию по теоремам о представлении для мартингалов, написанную под руководством Пьера Приуре (Pierre Priouret).

Марк интересовался многими областями теории вероятностей и теории случайных процессов, включая броуновское движение и процессы Бесселя. Он доказал теоремы представления и теоремы о характеристизации предельных точек множества эквивалентных вероятностных мер. В дальнейшем им были получены глубокие результаты о локальных временах для семимартингалов, в теории экскурсий и о вложении Скорохода, а также важные результаты по расширению фильтраций.

Его интересовала финансовая математика, в частности, распределения интегралов от геометрического броуновского движения, новые интерпретации формулы Блэка–Шоулза, распределение броуновских квантилей.

Область его интересов включала также функционалы от броуновского движения, в частности, квадратические функционалы (обобщения формулы Чисельского–Тейлора) и экспоненциальные функционалы, которые он обобщил для процессов Леви. Он изучал плоское броуновское движение, в том числе распределение его витков.

В последние годы Йор занимался матричнозначными стохастическими процессами и получил динамическую версию для больших матриц, а также распространил на процесс Уишарта некоторые свойства процессов Бесселя.

Марк Йор опубликовал более 400 статей (число его соавторов превысило сотню), написал 16 книг, среди которых особенно известна его книга с Д. Ревузом (D. Revuz) (первое издание вышло в свет в 1991 г.). В течение многих лет он был соредактором публикаций известных семинаров по теории вероятностей Страсбургского университета, руководил научной работой 40 кандидатов наук, среди которых были Жан-Франсуа Ле Галль (Jean-Francois Le Gall) и Жан Бертюан (Jean Bertoin).

Марк Йор участвовал в исследовании обнаруженного в 2000 г. «запечатанного пакета» Вольфганга Дёблина (Wolfgang Doeblin)¹, и был потрясен, поняв, что многие результаты современной теории стохастического исчисления были найдены еще в 1940-х годах.

Марк был известен своей простотой, скромностью и добротой. Каждый, кто когда-либо обращался к нему, всегда мог быть уверен, что его выслушают и дадут дельный совет. Он был замечательным преподавателем; его лекции оставляли ощущение простоты изложенных результатов, даже если по истечении времени вы понимали, насколько эти результаты сложны.

Мы потеряли исключительного математика и удивительного человека, который оказал огромное влияние на многих из нас.

М. Женблан, А. Ширяев

¹ См. B. Bru and M. Yor, Comments on the life and mathematical legacy of Wolfgang Doeblin. In: Finance and Stochastics, 2002, v. 6, p. 3–47, doi:10.1007/s780-002-8399-0. — *Ред.*