Math-Net.Ru

Общероссийский математический портал

В. А. Ватутин, Рецензия
на книгу Wimmer G., Altmann G. "Thesaurus of Univariate
Discrete Probability Distributions" 823, *Теория вероятн. и ее
примен.*, 2000, том 45, выпуск 4, 823

DOI: <https://doi.org/10.4213/tvp516>

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: 54.84.234.179

26 апреля 2023 г., 10:51:06

В целом книга представляет собой одно из уникальных явлений в математической литературе, и было бы очень полезно издать ее на русском языке.

9.01.2000

А. М. Зубков

Wimmer G., Altmann G. **Thesaurus of Univariate Discrete Probability Distributions**. Essen: STAMM Verlag, 1999, xxviii, 838 p. DM 198, \$ US 107, ISBN 3-87773-025-6 paperback.

Книги энциклопедического характера по теории вероятностей выходят из печати не часто. А монографии, в которых детально рассматриваются дискретные вероятностные распределения, вообще можно пересчитать по пальцам. В самой обширной из них, справочнике [1], упомянуты около 300 одномерных дискретных вероятностных распределений. В рецензируемом тезаурусе содержатся сведения о более чем 750 одномерных дискретных вероятностных распределениях и их семействах.

Принцип построения справочника таков. В алфавитном порядке перечислены все известные авторам, на момент выхода книги, одномерные дискретные вероятностные распределения. При этом каждому распределению присвоено основное имя (весьма часто совпадающее с именем автора статьи, в которой это распределение появилось впервые) и перечислены все известные авторам другие имена, под которыми это распределение когда-либо упоминалось. Некоторые из неосновных имен наверное вызовут удивление у многих специалистов по теории вероятностей. Например, имя «распределение Фарри (Furry distribution)», являющееся неосновным для геометрического распределения. Приводятся производящие функции распределения, описана область допустимых значений параметров, указываются связи рассматриваемого распределения с другими распределениями (частные и предельные случаи или обобщения). Заканчивается раздел, посвященный конкретному распределению, списком (как правило, весьма обширным) статей и книг, в которых это распределение упомянуто.

В конце справочника перечислены имена (основные и неосновные) всех распределений, включенных в книгу, а также дан список литературы, содержащий более 4000 наименований. Наверное, можно не соглашаться с принципом присвоения имен конкретным распределениям или спорить о том, правильные ли имена получили те или иные распределения и все ли связи упомянуты, но в любом случае перед нами титанический труд, заслуживающий уважения.

Эту книгу не обязательно иметь в личном пользовании, но она, безусловно, должна быть в каждой солидной научной библиотеке.

СПИСОК ЛИТЕРАТУРЫ

1. Johnson N. L., Kotz S., Kemp A. W. *Univariate Discrete Distributions*. New York: Wiley, 1992.

9.01.2000

В. А. Ватутин

Kallianpur G., Karandikar R. L. **Introduction to Option Pricing Theory**. Birkhauser, Boston-Basel-Berlin, 2000, 268 p.

Настоящая книга посвящена теории оценивания опционов, в основном, для диффузионных моделей финансовых рынков (модель Блэка и Шоулса). В ней систематически изложены элементы стохастического анализа, которые имеют принципиальное значение для данной области современной финансовой математики: мартингал, локальный мартингал, семимартингал, броуновское движение, момент остановки, стохастический интеграл Ито и его обобщение на непрерывные семимартингалы и т.д.; доказывается формула Ито для непрерывных семимартингалов и изучаются некоторые ее приложения (в частности, приложение ее к геометрическому броуновскому