

Англо-русский словарь используемых терминов

absolute risk aversion — абсолютная несклонность к риску
absolutely continuous measure — абсолютно непрерывная мера
acceptance set — приемлемое множество
acceptance set of a risk measure — приемлемое множество меры риска
adapted process — согласованный процесс
admissible strategy — допустимая стратегия
affine hull of a convex set — аффинная оболочка выпуклого множества
affine numerical representation — аффинное числовое представление
Allais paradox — парадокс Алле
American claim — американское (платежное) обязательство
American contingent claim — американское платежное обязательство
American option — американский опцион
American put option — американский опцион продажи (пут)
American call option — американский опцион покупки (колл)
antisymmetric relation — антисимметричное отношение предпочтения
arbitrage bounds — арбитражные границы
arbitrage opportunity — арбитражная возможность
arbitrage-free price — безарбитражная цена
arbitrage-free market model — безарбитражный рынок (модель безарбитражного рынка)
Archimedean axiom — аксиома Архимеда
Arrow—Debreu equilibrium — равновесие Эрроу—Дебре
Arrow—Pratt coefficient — коэффициент Эрроу—Пратта
Asian option — азиатский опцион
Asian put option — азиатский опцион продажи
asymmetric relation — асимметричное отношение (предпочтения)
asymmetry of preference relation — асимметрия отношения предпочтения
at-the-money option — «нейтральный» опцион
atom of a probability space — атом вероятностного пространства
atomless probability space — вероятностное пространство без атомов
attainable American claim — достижимое американское (платежное) обязательство
attainable European claim — достижимое европейское (платежное) обязательство
attainable payoff — достижимая выплата
average price call option — опцион покупки с усредненной ценой (акции)
average strike call option — опцион покупки с усредненной ценой исполнения
Average Value at Risk — средняя мера риска $V@R$

- balayage order — порядок выметания
Banach space — банахово пространство
Banach—Alaoglu theorem — теорема Банаха—Алаоглу
barrier option — барьерный опцион
barycenter of a measure — центр масс меры
basket call option — пакетный опцион покупки
basket option — пакетный опцион
Bermuda option — бермудский опцион
binomial model — биномиальная модель (рынок Кокса—Росса—Рубинштейна, KRR-рынок)
Black—Scholes formula — формула Блэка—Шоулса
Black—Scholes p.d.e. — уравнение в частных производных Блэка—Шоулса
Black—Scholes price — цена Блэка—Шоулса
Bolzano—Weierstrass theorem — теорема Больцано—Вейерштрасса
boundedly supported measures — меры с ограниченным носителем
Brownian motion — броуновское движение
butterfly spread — контракт «бабочка»
- call option — опцион покупки (колл-опцион)
call-put parity — колл-пут паритет
cap — предел (для дисконтного сертификата)
CARA utility — CARA полезность (функция полезности с постоянной абсолютной несклонностью к риску)
cash invariance — инвариантность относительно сдвига
cash invariant measure of risk — мера риска, инвариантная относительно сдвига
catastrophe bond — облигация катастроф
central limit theorem — центральная предельная теорема
certainty equivalent — детерминированный эквивалент
certainty independence — независимость от детерминированной компоненты
change of numéraire — замена дисконтирующего актива
Choquet boundary — граница Шоке
Choquet integral — интеграл Шоке
coherent risk measure — когерентная мера риска
comonotone random variables — комонотонные случайные величины
comonotonic measure of risk — комонотонная мера риска
comonotonicity — комонотонность
comonotonicity of Value at Risk — комонотонность меры риска $V@R$
complete market (model) — полный рынок (модель полного рынка)
complete relation — полное отношение предпочтения
compound lottery — сложная лотерея
concave stochastic order — выпуклый стохастический порядок
conditional coherent risk measure — условная когерентная мера риска
conditional expectation — условное математическое ожидание
Conditional Value at Risk — условная мера риска $V@R$
conjugate function — сопряженная функция
conjugate function of a convex risk measure — сопряженная функция к выпуклой мере риска

- connected topological space — связанное топологическое пространство
 constant absolute risk aversion — постоянная абсолютная несклонность к риску
 constant relative risk aversion — постоянная относительная несклонность к риску
 contingent claim — платежное обязательство
 continuation region — область продолжения
 continuity axiom — аксиома непрерывности
 continuity from above — непрерывность сверху
 continuity from below — непрерывность снизу
 convergence theorem for martingales — теорема сходимости для мартингалов
 convex function — выпуклая функция
 convex hull — выпуклая оболочка
 convex hull of the support of a measure — выпуклая оболочка носителя меры
 convex measure of risk — выпуклая мера риска
 convex stochastic order — выпуклый стохастический порядок
 core of a set function — ядро функции множеств
 cost of superhedging — затраты на суперхеджирование
 cost process — процесс затрат
 countably convex set — счетно-выпуклое множество
 Cox—Ross—Rubinstein model — рынок Кокса—Росса—Рубинштейна (КРР-рынок)
 CRR model — рынок Кокса—Росса—Рубинштейна (КРР-рынок)
 CRRA utility — CRRA полезность (функция полезности с постоянной относительной несклонностью к риску)
- decline of a favorable bet — отклонение благоприятного пари
 decreasingly risk averse utility function — функция полезности с убывающей несклонностью к риску
 Delta hedging — дельта-хедж
 Delta of a call option — дельта опциона покупки
 density function — функция плотности
 density process — процесс плотностей
 derivative securities — производные ценные бумаги
 digital option — цифровой опцион
 Dini's lemma — лемма Дини
 Dirac measure — мера Дирака
 discount certificate — дисконтный сертификат
 discounted American claim — дисконтированное американское обязательство
 discounted claim — дисконтированное обязательство
 discounting — дисконтирование
 distortion function — искажающая функция
 distortion of a probability measure — искажение вероятностной меры
 distribution — распределение
 distribution function — функция распределения
 diversification — диверсификация
 Doléans-Dade exponential — экспонента Долеан-Дэд
 Donsker—Prokhorov invariance principle — принцип инвариантности Донскера—Прохорова
 Doob decomposition — разложение Дуба

- Doob's stopping theorem — теорема Дуба об остановке
Doob's systems theorem — (первая) системная теорема Дуба (для мартингалов)
down-and-in option — нижний опцион входа
down-and-out option — нижний опцион выхода
dual space — сопряженное пространство
duality theory of convex functions — теория двойственности для выпуклых функций
Dunford—Pettis theorem — теорема Данфорда—Петтиса
dynamic coherent risk measure — динамическая когерентная мера риска
dynamic consistency of a risk measure — динамическая согласованность меры риска
- early exercise premium — премия при раннем предъявлении
Eberlein—Šmulian theorem — теорема Эберлейна—Шмульяна
efficient hedging — эффективное хеджирование
efficient market hypothesis — предположение об эффективности рынка
Ellsberg paradox — парадокс Эллсберга
entropic risk measure — энтропийная мера риска
entropy of a measure — энтропия меры
entropy-minimizing risk-neutral measure — риск-нейтральная мера, минимизирующая энтропию
epigraph of a convex function — надграфик выпуклой функции
equivalence relation — отношение эквивалентности
equivalent martingale measure — эквивалентная мартингальная мера
equivalent measure — эквивалентная (вероятностная) мера
Esscher transform — преобразование Эшера
essential infimum — существенный инфимум
essential supremum — существенный супремум
European call option — европейский опцион покупки
European contingent claim — европейское платежное обязательство
European put option — европейский опцион продажи
exercise strategy for American claim — стратегия исполнения американского платежного обязательства
expected shortfall — ожидаемый дефицит
expiration date of a contingent claim — дата исполнения (европейского) платежного обязательства
exponential family — экспоненциальное семейство
exponential utility function — экспоненциальная функция полезности
extreme point — крайняя точка
- fair premium — справедливая премия
fair price — справедливая цена
Fatou property — свойство Фату
Fatou property on L^p — свойство Фату в L^p
favorable bet — благоприятное пари
feasible allocation — допустимое размещение
Fenchel—Legendre transform — преобразование Фенхеля—Лежандра
filtered probability space — вероятностное пространство с фильтрацией
filtration — фильтрация

financial position — финансовая позиция
 finitely additive set function — конечно-аддитивная функция множеств
 first order stochastic dominance — стохастическое доминирование первого рода
 fork convex sets — вилочно выпуклые множества
 forward contract — форвардный контракт
 Fréchet bounds — границы Фреше
 functional central limit theorem — функциональная центральная предельная теорема
 fundamental theorem of asset pricing — фундаментальная теорема формирования цен финансовых активов

gains process — процесс доходов
 Gamma of a call option — гамма опциона покупки
 gauge function — калибровочная функция
 generalized likelihood quotient test — обобщенный критерий отношения правдоподобия
 generalized Neyman—Pearson lemma — обобщенная лемма Неймана—Пирсона
 generalized trading strategy — обобщенная стратегия (торговли)
 geometric Brownian motion — геометрическое броуновское движение
 Girsanov formula — формула Гирсанова
 global quadratic risk — глобальный квадратичный риск
 Greeks — «греки» (опциона покупки)

Hahn—Banach theorem — теорема Хана—Банаха
 Halmos—Savage theorem — теорема Халмоща—Сэвиджа
 HARA utility — HARA полезность (функция полезности с гиперболической абсолютной несклонностью к риску)
 Hardy—Littlewood inequality — неравенство Харди—Литлвуда
 Hausdorff (topological) space — (топологическое) хаусдорфово пространство
 hedging strategy for American claim — хеджирующая стратегия для американского (платежного) обязательства
 hyperbolic absolute risk aversion — гиперболическая абсолютная несклонность к риску

in-the-money option — «выгодный» опцион
 independence axiom — аксиома независимости
 indifference relation — отношение безразличия
 inequality, Hardy—Littlewood — неравенство Харди—Литлвуда
 insurance — страхование
 interest rate — процентная ставка
 intrinsic value — внутренняя стоимость
 inverse function — обратная функция
 Itô's formula — формула Ито
 Itô's integral — интеграл Ито

James' theorem — теорема Джеймса

knock-in option — опцион входа
 knock-out option — опцион выхода
 Kolmogorov's law of large numbers — закон больших чисел Колмогорова
 Krein—Šmulian theorem — теорема Крейна—Шмульяна

- Kreps—Yan theorem — теорема Крепса—Яна
Kunita—Watanabe decomposition — разложение Кунита—Ватанабе
- law-invariant risk measure — инвариантная по распределению мера риска
law of large numbers — закон больших чисел
law of one price — закон единой цены
Lebesgue decomposition — разложение Лебега
left-continuous inverse function — непрерывная слева обратная функция
Legendre transform — преобразование Лежандра
leverage effect — эффект рычага
lexicographical order — лексикографический порядок
lexicographical preference relation — лексикографическое отношение предпочтения
likelihood quotient test — критерий отношения правдоподобия
liquid option — ликвидный опцион
local quadratic risk — локальный квадратичный риск
local martingale — локальный мартингал
local risk process — процесс локального риска
local submartingale — локальный субмартингал
local supermartingale — локальный супермартингал
locally convex space — локально выпуклое пространство
locally risk-minimizing strategy — стратегия, минимизирующая локальный риск
locally riskless bond — локально безрисковая облигация
log-normal distribution — логнормальное распределение
lookback call option — опцион покупки с последствием
lookback option — опцион с последствием
lookback put option — опцион продажи с последствием
loss function — функция потерь
lottery — лотерея
lower quantile function — нижняя квантильная функция
lower Snell envelope — нижняя огибающая Снелла
- m -stable sets — m -устойчивые множества
market clearing condition — условие баланса
market portfolio — рыночный портфель
Markov property — марковское свойство
martingale — мартингал
martingale of successive densities — мартингал, образованный последовательными плотностями
martingale measure — мартингальная мера
martingale representation property — свойство мартингальной представимости
maturity of a contingent claim — дата исполнения (погашения) платежного обязательства
mean self-financing strategy — самофинансируемая в среднем стратегия
mean-preserving spread — ядро, сохраняющее среднее значение
mean-variance trade-off process — процесс среднеквадратичной замены
measure — мера
measure of risk — мера риска

- metric space — метрическое пространство
minimal martingale measure — минимальная мартингальная мера
mixture space — пространство смесей
model uncertainty — неопределенность в модели
moment generating function — производящая функция моментов
monetary measure of risk — монетарная мера риска
monotone measure of risk — монотонная мера риска
monotone preference relation — монотонное отношение предпочтения
monotone set function — монотонная функция множеств
multi-period market model — многошаговая модель рынка
multiplicative version of the central limit theorem — мультипликативный вариант центральной предельной теоремы
- negative transitive relation — отрицательно транзитивное отношения (предпочтения)
Neyman—Pearson lemma — лемма Неймана—Пирсона
non-redundance condition — условие избыточности
normal distribution — нормальное распределение
normalized measure of risk — нормированная мера риска
normalized set function — нормированная функция множеств
numéraire — дисконтирующий актив
numerical representation — числовое представление
numerical representation of a preference relation — числовое представление отношения предпочтения
- one-period market model — одношаговая модель рынка
optimal stopping problem — задача оптимальной остановки
option — опцион
optional decomposition — опциональное разложение
optional decomposition of an upper Snell envelope — опциональное разложение верхней огибающей Снелла
optional decomposition theorem — теорема об опциональном разложении
optional sampling theorem — теорема о свободном выборе
order dense set — плотное по порядку множество
orthogonal decomposition — ортогональное разложение
out-of-the-money option — «невыгодный» опцион
- paradox — парадокс
partial order — частичный порядок
pasting of two probability measures — склейка двух вероятностных мер
penalty function — штрафная функция
penalty function for convex measure of risk — штрафная функция выпуклой меры риска
Poisson distribution — пуассоновское распределение
Polish space — польское пространство
portfolio — портфель
portfolio insurance — страхование портфеля
positive affine transformations — положительное аффинное преобразование
positive homogeneous measure of risk — положительно однородная мера риска

- power of a statistical test — мощность статистического критерия
predictable process — предсказуемый процесс
predictable representation property — свойство предсказуемой представимости
predictably convex set — предсказуемо выпуклое множество
preference order — порядок предпочтения
preference relation — отношение предпочтения
price density — ценовая плотность
price measure — ценовая мера
price system — система цен
pricing measure — ценообразующая мера
pricing rule — ценообразующее правило
probability measure — вероятностная мера
Prokhorov's theorem — теорема Прохорова
proper convex function — собственная выпуклая функция
put option — опцион продажи (пут-опцион)
put-call parity — пут-колл паритет
- quadratic risk — квадратичный риск
quantile function — квантильная функция
quantile function for non-additive set functions — квантильная функция относительно неаддитивной функции множеств
quantile hedging — квантильное хеджирование
- Radon—Nikodym derivative — производная Радона—Никодима
Radon—Nikodym theorem — теорема Радона—Никодима
remaining quadratic risk — остаточный квадратичный риск
random preference relation — случайное отношение предпочтения
random utility function — случайная функция полезности
random walk — случайное блуждание
randomized test — рандомизированный критерий
redundant contingent claim — платежное обязательство, допускающее репликацию
redundant European contingent claim — европейское платежное обязательство, допускающее репликацию
reference portfolios — пространство «основных портфелей»
reflection principle — принцип отражения
reflexive relation — рефлексивное отношение предпочтения
regular conditional distribution — регулярное условное распределение
relation — отношение (предпочтения)
relative entropy — относительная энтропия
relative interior of a convex set — относительная внутренность выпуклого множества
relative risk aversion — относительная несклонность к риску
relevant risk measure — уместная мера риска
remaining conditional risk — остаточный условный риск
replicable contingent claim — платежное обязательство, допускающее репликацию
replicable European contingent claim — европейское платежное обязательство, допускающее репликацию
replicating portfolio — реплицирующий портфель

- replicating strategy — реплицирующая стратегия
 representation theorem for risk measures — теорема о представлении для меры риска
 reservation price — цена резервирования
 return — норма прибыли
 reverse convertible bond — обратно-конвертируемая облигация
 reverse martingale — обратный мартингал
 Rho of a call option — ρ опциона покупки
 right-continuous inverse function — непрерывная справа обратная функция
 risk averse preference relation — отношение предпочтения, несклонное к риску
 risk aversion — несклонность к риску
 risk measure — мера риска
 risk neutrality — безразличие к риску
 risk premium — премия за риск
 risk transfer — перемещение риска
 risk-neutral measure — риск-нейтральная мера
 robust Savage representation — робастное представление Сэвиджа
 robust shortfall risk — робастный риск дефицита
 running maximum — текущий максимум
- Savage representation — представление Сэвиджа
 second fundamental theorem of asset pricing — вторая фундаментальная теорема формирования цен финансовых активов
 second order stochastic dominance — стохастическое доминирование второго рода
 securities — ценные бумаги
 self-financing strategy — самофинансируемая стратегия
 sensitive risk measure — чувствительная мера риска
 separable metric space — сепарабельное метрическое пространство
 separating hyperplane theorem — теорема об отделяющей гиперплоскости
 separation theorem — теорема делимости
 set function — функция множеств
 set function, 2-alternating — субмодулярная функция множеств
 Sharpe ratio — отношение Шарпа
 short sales — короткие продажи
 shortfall — дефицит
 shortfall risk — риск дефицита
 significance level of a statistical test — уровень значимости статистического критерия
 simple measure — простая мера
 simple probability distribution — простое вероятностное распределение
 size of a statistical test — уровень значимости статистического критерия
 Snell envelope — огибающая Снелла
 space of reference portfolios — пространство «основных портфелей»
 St. Petersburg paradox — Санкт-Петербургский парадокс
 stability under pasting — устойчивость при склейке
 stable set of measures — устойчивое множество мер
 stable subspace of \mathcal{H}^2 — устойчивое подпространство в \mathcal{H}^2
 standard normal distribution — стандартное нормальное распределение
 statistical test — статистический критерий

- stochastic differential equation — стохастическое дифференциальное уравнение
stochastic dominance — стохастическое доминирование
stochastic kernel — стохастическое ядро
stochastic order — стохастический порядок
stochastic process — случайный процесс
stop-loss contract — контракт, ограничивающий убытки
stopping region — область остановки
stopping theorem — теорема (Дуба) об остановке
stopping time — момент остановки
straddle — стеллаж
strategy — стратегия
stress test measures — меры отсеивающего критерия
strike price — цена исполнения (погашения)
strong law of large numbers — усиленный закон больших чисел
strong orthogonality — сильная ортогональность
strongly orthogonal martingale — сильно ортогональный мартингал
subadditive measure of risk — субаддитивная мера риска
submartingale — субмартингал
submodular set function — субмодулярная функция множеств
substitution axiom — аксиома подстановки
success ratio — отношение успешности
success set — множество успешности
superhedging — суперхеджирование
superhedging duality — двойственность суперхеджирования
superhedging duality theorem — теорема о двойственности суперхеджирования
superhedging strategy — стратегия суперхеджирования
supermartingale — супермартингал
superreplication strategy — суперреплицирующая стратегия
support of a measure — носитель меры
supremum norm — равномерная норма
sure-thing principle — принцип обязательности
systems theorem — первая системная теорема (Дуба) (для мартингалов)
- Theta of a call option — тета опциона покупки
tight measure of risk — плотная мера риска
tightness — плотность
tightness of a set of measures — плотность семейства мер
tightness of a risk measure — плотность меры риска
time consistency of a risk measure — согласованность во времени меры риска
time value — временная стоимость
topological space — топологическое пространство
topological vector space — топологическое векторное пространство
topology — топология
total variation — полная вариация
trading strategy — (торговая) стратегия
transitivity relation — отношение транзитивности
translation invariance — инвариантность относительно сдвига

type 1 error — ошибка первого рода

type 2 error — ошибка второго рода

uncertainty aversion — несклонность к неопределенности

uniform Doob decomposition — равномерное разложение Дуба

universal arbitrage bounds — универсальные арбитражные границы

up-and-in call option — верхний колл-опцион входа

up-and-in option — верхний опцион входа

up-and-out call option — верхний колл-опцион выхода

up-and-out option — верхний опцион выхода

upper $Q_{\mathcal{S}}$ -Snell envelope — верхняя $Q_{\mathcal{S}}$ -огibaющая Снелла

upper hedging price — верхняя цена хеджирования

upper quantile function — верхняя квантильная функция

upper Snell envelope — верхняя огibaющая Снелла

utility function — функция полезности

Value at Risk — мера риска $V@R$

value process — процесс стоимости

variance — дисперсия

variance of a lottery — дисперсия лотереи

variance-optimal strategy — квадратично-оптимальная стратегия

vector lattice — векторная решетка

Vega of a call option — вега опциона покупки

volatility — волатильность

von Neumann–Morgenstern representation — представление фон Неймана–Моргенштерна

weak preference order — слабое отношение предпочтения

weak preference relation — слабое отношение предпочтения

weak topology — слабая топология

weak topology for measures — слабая топология на пространстве мер

weak* topology — слабая* топология

weakly compact set — слабо компактное множество

Wiener measure — винеровская мера

Wiener process — винеровский процесс

worst conditional expectation — наихудшее условное ожидание

worst-case risk measure — мера риска наихудшего случая