

Introduction to stochastic integration

Type de contenu : Texte

Type de médiation : sans médiation

Titre(s) : Introduction to stochastic integration / Kuo, Hui-Hsiung

A pour autre édition sur un support différent : Introduction to stochastic integration Texte électronique
9780387310572

Auteur(s) : Kuo, Hui-Hsiung (1941-....)

Editeur, producteur : New York : Springer, 2006

Description matérielle : XIII-278 p. ; 24 cm

Collection : Universitext

ISBN : 0-387-28720-5
978-0387-28720-1

Appartient à la collection : Universitext (1979) 0172-5939 2006

Classification décimale Dewey : 519.23 23

Note sur les bibliographies et les index : Bibliogr. p. 267-270

Résumé ou extrait : Sommaire : motion brownienne. Constructions de motions browniennes. Intégrales stochastiques. La formule Itô. Applications de la formule Itô. Intégrales multiples Wiener-Itô. Equations différentielles stochastiques. Applications.

Sujet(s) : processus stochastique
probabilités : mathématiques
martingale (mathématiques)

Sujet - Nom commun : Intégrales stochastiques
Martingales (mathématiques)