

Mouvement brownien et calcul d'Itô : cours et exercices corrigés

Type de contenu : Texte

Type de médiation : sans médiation

Titre(s) : Mouvement brownien et calcul d'Itô : cours et exercices corrigés / Gallardo, Léonard

Auteur(s) : Gallardo, Léonard

Editeur, producteur : Paris : Hermann, impr. 2008
(91-Courtaboeuf; Impr. Cogetefi)

Description matérielle : IX-241 p. ; 22 cm

Collection : Méthodes mathématiques ingénieur, doctorat, master

ISBN : 978-2-7056-6797-9

EAN : 9782705667979

Appartient à la collection : Collection Méthodes (Paris. 1966) 0588-2303 2008

Classification décimale Dewey : 519.23 23

Note sur les bibliographies et les index : Bibliogr. p. 237-241. Index

Résumé ou extrait : Introduction aux processus stochastiques. Le mouvement brownien. Le mouvement brownien comme processus de Markov. Construction de l'intégrale stochastique. Notions sur le calcul stochastique d'Itô. Avec des exercices de difficulté variée et leurs solutions.

Sujet(s) : Markov, processus de
mathématiques : discipline
mouvement brownien
processus stochastique

Sujet - Nom commun : Processus de mouvement brownien
Intégrales d'Itô