

<<随机积分和微分方程>>

图书基本信息

书名：<<随机积分和微分方程>>

13位ISBN编号：9787506291972

10位ISBN编号：7506291975

出版时间：2008-4

出版时间：普若特 (Protter P.E) 世界图书出版公司 (2008-04出版)

作者：普若特

页数：419

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

<<随机积分和微分方程>>

内容概要

本书是第2版（全英文版）。

第1版本的《随机积分和微分方程》问世13年以来，有关这方面的书不断涌现，特别是在数学金融方面具有很强应用性的书更是发展迅速。

然而没有一本书是真正用函数解析法来表达半鞅和随机积分，这使得新的方法并没有得到很好的应用。

尽管这本书不再适合称其为一种新的方法。

然而新版本的及时出现，在很大程度上完善了原版本。

这版较第1版做了一些调整，并且增加了不少新的内容。

第3章增加了停时的分类和Bichteler-Dellacherie定理；第4章增加了鞅表示的Jacod-Yor定理、鞅表示的例子以及Sigma鞅；增加了新的一章第6章。

并且每章的后面增加了不少练习，这些可以作为学习本教材的很好的补充。

<<随机积分和微分方程>>

作者简介

作者：(美国)普若特(Protter P.E)

<<随机积分和微分方程>>

书籍目录

Introduction
 1 Preliminaries
 1 Basic Definitions and Notation
 2 Martingales
 3 The Poisson Process and Brownian Motion
 4 Levy Processes
 5 Why the Usual Hypotheses?
 6 Local Martingales
 7 Stieltjes Integration and Change of Variables
 8 Naive Stochastic Integration is Impossible
 Bibliographic Notes
 Exercises for Chapter 1
 2 Semimartingales and Stochastic Integrals
 1 Introduction to Semimartingales
 2 Stability Properties of Semimartingales
 3 Elementary Examples of Semimartingales
 4 Stochastic Integrals
 5 Properties of Stochastic Integrals
 6 The Quadratic Variation of a Semimartingale
 7 Ito's Formula (Change of Variables)
 8 Applications of Ito's Formula
 Bibliographic Notes
 Exercises for Chapter 2
 3 Semimartingales and Decomposable Processes
 1 Introduction
 2 The Classification of Stopping Times
 3 The Doob-Meyer Decompositions
 4 Quasimartingales
 5 Compensators
 6 The Fundamental Theorem of Local Martingales
 7 Classical Semimartingales
 8 Girsanov's Theorem
 9 The Bichteler-Dellacherie Theorem
 Bibliographic Notes
 Exercises for Chapter 3
 4 General Stochastic Integration and Local Times
 1 Introduction
 2 Stochastic Integration for Predictable Integrand
 3 Martingale Representation
 4 Martingale Duality and the Jacod-Yor Theorem on Martingale Representation
 5 Examples of Martingale Representation
 6 Stochastic Integration Depending on a Parameter
 7 Local Times
 8 Az6ma's Martingale
 9 Sigma Martingales
 Bibliographic Notes
 Exercises for Chapter 4
 5 Stochastic Differential Equations
 1 Introduction
 2 The H_{∞} Norms for Semimartingales
 3 Existence and Uniqueness of Solutions
 4 Stability of Stochastic Differential Equations
 5 Fisk-Stratonovich Integrals and Differential Equations
 6 The Markov Nature of Solutions
 7 Flows of Stochastic Differential Equations: Continuity and Differentiability
 8 Flows as Diffeomorphisms: The Continuous Case
 9 General Stochastic Exponentials and Linear Equations
 10 Flows as Diffeomorphisms: The General Case
 11 Eclectic Useful Results on Stochastic Differential Equations
 Bibliographic Notes
 Exercises for Chapter 5
 6 Expansion of Filtrations
 1 Introduction
 2 Initial Expansions
 3 Progressive Expansions
 4 Time Reversal
 Bibliographic Notes
 Exercises for Chapter 6
 References
 Subject Index

<<随机积分和微分方程>>

编辑推荐

《随机积分和微分方程(第2版)》是真正用函数解析法来表达半鞅和随机积分，这使得新的方法并没有得到很好的应用。

尽管这《随机积分和微分方程(第2版)》不再适合称其为一种新的方法。

然而新版本的及时出现，在很大程度上完善了原版本。

<<随机积分和微分方程>>

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>