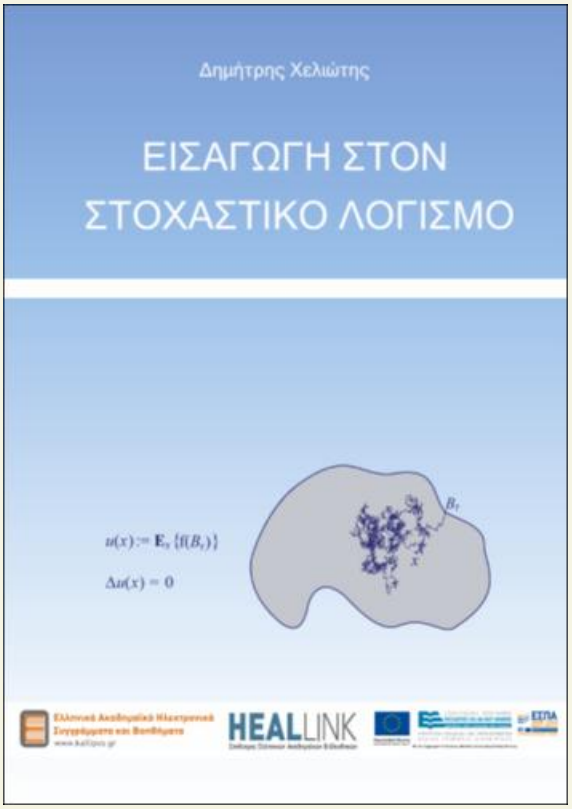

METADATA

Title: Εισαγωγή στον στοχαστικό λογισμό

Other Titles: -

Language: Greek

ISBN: 978-960-603-297-4

Subject: MATHEMATICS AND COMPUTER SCIENCE

Keywords: Brownian Motion / Martingales / Mathematical Finance / Conditional Expectation

Bibliographic Reference: Cheliotis, D. (2015). Εισαγωγή στον στοχαστικό λογισμό [Undergraduate textbook]. Kallipos, Open Academic Editions. http://dx.doi.org/10.57713/kallipos-605

Abstract

Τα θέματα που θα πραγματεύται το βιβλίο είναι

α) Δεσμευμένη μέση τιμή, martingales (σε διακριτό χρόνο), και εφαρμογές τους.

β) Κίνηση Brown.

γ) Κατασκευή του ολοκληρώματος Ito. Τύπος του Ito.

δ) Στοχαστικές διαφορικές εξισώσεις.

ε) Στοιχεία από τα χρηματοοικονομικά μαθηματικά, και εφαρμογή του στοχαστικού λογισμού στην τιμολόγηση παράγωγων προϊόντων. Εξίσωση Black-Scholes.

The Project is funded by the National Development Programme 2021-2025 of the Ministry of Education and Religious Affairs and implemented by the Special Account for Research Funds of the National Technical University of Athens and the Hellenic Academic Libraries Link.