



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://hdl.handle.net/11419/4143>

Abstract

Τα θέματα που θα πραγματεύεται 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.