

<<随机微分方程引论>>

图书基本信息

书名：<<随机微分方程引论>>

13位ISBN编号：9787301004753

10位ISBN编号：7301004753

出版时间：1995-1

出版时间：北京大学出版社

作者：龚光鲁 编

页数：559

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>

<<随机微分方程引论>>

内容概要

本书着重介绍随机微分方程的强解、弱解及其与扩散和带跳跃的马氏过程间的联系。

第一章讨论Brown运动的随机积分。

第二章介绍了随机过程的一般理论的梗概。

着重于随机过程的对偶投影理论。

第三章与第四章讨论了连续半鞅的随机微分方程的强解。

Ito方程的弱解，马氏型Ito方程弱解的存在唯一性条件及其与扩散过程的联系。

第五章讨论一维情形，着重论述边界点的分类、常返性与保守性。

第六章介绍带边界的随机微分方程与扩散，Fichera边界分类。

第七章给出了一般半鞅的分解及Ito公式，拟左连续的O有限点过程的积分。

还讨论了带有平稳点过程的典型情形。

本书最后还有一个关于连续鞅与Brown运动构造及凸函数的广义导数的简短附录。

<<随机微分方程引论>>

书籍目录

第一章 Brown运动的随机积分1.1 有关Brown运动的某些性质1.2 Ito积分的可积函数1.3 平方可积鞅与局部平方可积鞅1.4 对Brown运动的Ito积分1.5 Ito积分的例子1.6 关于无穷限情形的注记1.7 Ito过程与Ito积分的链法则——Ito公式1.8 指数上鞅与指数鞅1.9 随机积分的内蕴时间1.10 Brown运动的平衡与Girsanov变换1.11 Brown参考族及有关于它的局部鞅习题第二章 鞅与鞅的随机积分2.1 严格事前代数及可料时2.2 截口定理2.3 过程的投影理论与(DL)类下鞅的Doob-Meyer分解2.4 局部平方可积鞅的特征与随机积分2.5 局部平方可积鞅的分解2.6 半鞅及对半鞅的随机积分2.7 连续半鞅的Ito公式与随机微积分计算2.8 连续半鞅的局部时2.9 Brown局部时的Engelbert-Schmidt零一律习题第三章 随机微分方程的一般概念3.1 连续半鞅的随机微分方程3.2 简单的例子3.3 Brown运动的随机微分方程, 弱解与分布唯一性3.4 弱解与鞅问题3.5 Prohorov-Skorohod方法3.6 (弱)解的存在性3.7 含 x 函数的Ito过程与Ito公式习题第四章 齐次马氏型随机微分方程4.1 解的存在性与分布唯一性4.2 有限时间可能爆炸的解4.3 随机微分方程的解和扩散过程4.4 扩散族的弱收敛第五章 一维随机微分方程与一维扩散第六章 具有边界的随机微分方程第七章 对半鞅的积分和含点过程的随机微分方程附录 一般记号特殊记号首次出现的章节名词索引参考文献

<<随机微分方程引论>>

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>