# <<随机积分导论(第2版)(影印版)>>

## 图书基本信息

书名：<<随机积分导论(第2版)(影印版)>>

13位ISBN编号：9787510070259

10位ISBN编号：7510070252

出版时间：2014-3

出版时间：世界图书出版公司

作者：K. L. Chung,R. J. Williams

## 内容概要

这是一部可读性很强的讲述随机积分和随机微分方程的入门教程。
将基本理论和应用巧妙结合，非常适合学习过概率论知识的研究生，学习随机积分。
运用现代方法，随机积分的定义是为了可料被积函数和局部鞅，紧接着是连续鞅的变分公式ito变化。
《随机积分导论（第2版）》包括在布朗运动的描述、鞅的hermite多项式、feynman-kac泛函和schrodinger方程。
这是第二版，讨论了cameron-martin-giranov变换，并且在最后一章引入随机微分方程和一些学生用的练习。

目次：基础；随机积分的定义；可料被积函数的扩展；二次变分过程；ito公式；ito公式的应用；局部时间和tanaka公式；反射布朗运动；推广的ito公式，时间和测度的变化；随机微分方程。

读者对象：数学专业、概论论、随机统计等学科的研究生和科研人员。

书籍目录

<<随机积分导论(第2版)(影印版)>>

## 版权说明