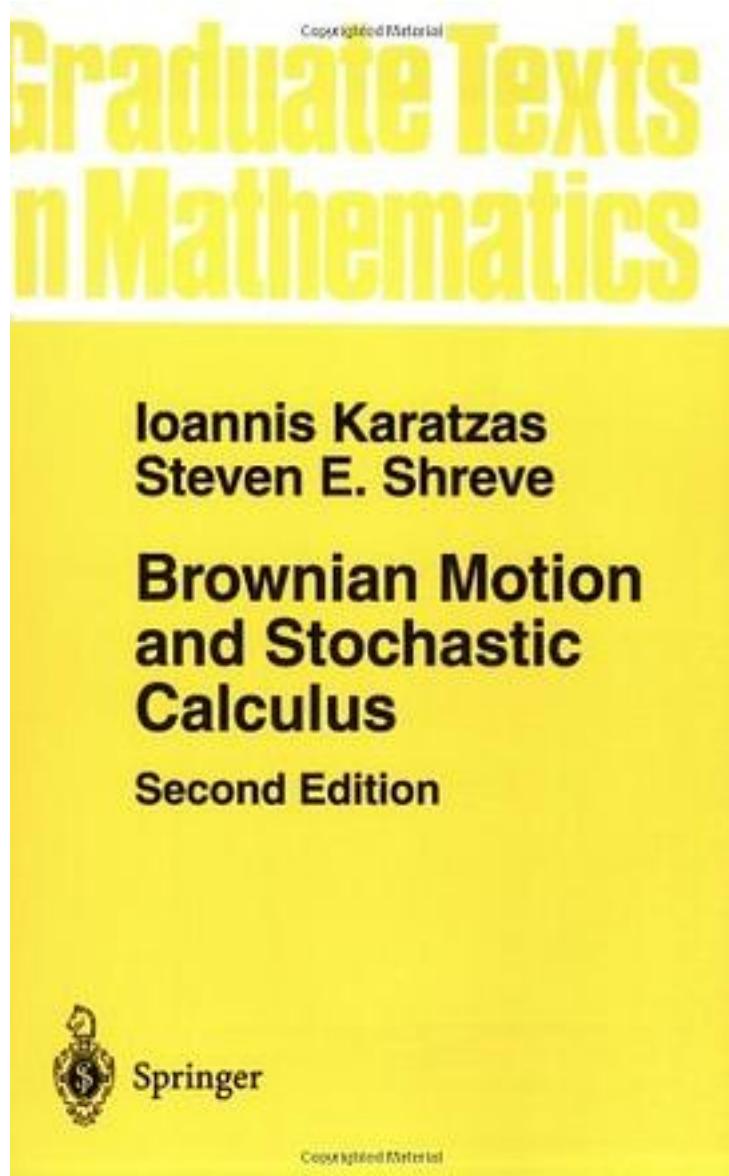


Brownian Motion and Stochastic Calculus



[Brownian Motion and Stochastic Calculus 下载链接1](#)

著者:Ioannis Karatzas

出版者:Springer-Verlag Telos

出版时间:1998-6

装帧:Paperback

isbn:9783540976554

作者介绍:

目录:

[Brownian Motion and Stochastic Calculus 下载链接1](#)

标签

金融

数学

评论

[Brownian Motion and Stochastic Calculus 下载链接1](#)

书评

这本书的特点是非常全面，一切关于布朗运动的知识、连续半鞅随机积分ITO公式的各种变形，都可以从该书找到，不是正文就是习题。写得也极具启发性，比如和一个stopping time相联系的sigma代数filtration，一般的书都是直接给出个定义，只有这本书解释了为什么会有这样的定...

这书写作上有些问题。读前两章时根本不知道作者要干什么，直到读到第三章，才发现原来这是一本关于鞅论的书。读到四五章才明白前面忙活半天是为了什么。到最后一章又不明白作者要干什么了。

这完全是本反方向的书，既不从特殊到一般，又不从应用引出理论。上来就直接对鞅对局部...

[Brownian Motion and Stochastic Calculus 下载链接1](#)