



# Universiteit van Pretoria Jaarboek 2018

## Stogastiese calculus 764 (WTW 764)

**Kwalifikasie** Nagraads

**Fakulteit** [Fakulteit Natuur- en Landbouwetenskappe](#)

**Modulekrediete** 15.00

**Programme** [BScHons Toegepaste Wiskunde](#)

[BScHons Wiskunde](#)

[BScHons Wiskunde en Wiskundeonderwys Algebra en Analise](#)

[BScHons Wiskunde en Wiskundeonderwys Differentiaalvergelings en Modelling](#)

[BScHons Wiskunde en Wiskundeonderwys Toegepaste Analise](#)

[BScHons Wiskunde van Finansies](#)

**Voorvereistes** WTW 734 of WTW 735

**Kontaktyd** 2 lesings per week

**Onderrigtaal** Module word in Engels aangebied

**Departement** Wiskunde en Toegepaste Wiskunde

**Aanbiedingstydperk** Semester 2

### Module-inhoud

\*Hierdie inligting is slegs in Engels beskikbaar.

Mathematical modelling of Random walk. Conditional expectation and Martingales. Brownian motion and other Lévy processes. Stochastic integration. Ito's Lemma. Stochastic differential equations. Application to finance.

Die inligting wat hier verskyn, is onderhewig aan verandering en kan na die publikasie van hierdie inligting gewysig word.. Die [Algemene Regulasies \(G Regulasies\)](#) is op alle fakulteite van die Universiteit van Pretoria van toepassing. Dit word vereis dat elke student volkome vertrouwd met hierdie regulasies sowel as met die inligting vervat in die [Algemene Reëls](#) sal wees. Onkunde betreffende hierdie regulasies en reëls sal nie as 'n verskoning by oortreding daarvan aangebied kan word nie.