

Universiteit van Pretoria Jaarboek 2017

Stogastiese calculus 764 (WTW 764)

Kwalifikasie	Nagraads
Fakulteit	Fakulteit Natuur- en Landbouwetenskappe
Modulekrediete	15.00
Programme	BScHons Toegepaste Wiskunde BScHons Wiskunde BScHons Wiskunde van Finansies
Voorvereistes	WTW 734 of WTW 735
Kontaktyd	2 lesings per week
Onderrigtaal	Module word in Engels aangebied
Akademiese organisasie	Wiskunde en Toegepaste Wisk
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.