

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 Differensiaalvergelykings 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.