

Εξεταστέα Ύλη στη Ύστοχαστική Μοντελοποίηση 2024-25

11 Ιανουαρίου 2025

Από το βιβλίο των Γ. Κουμουλλή- Σ. Νεγρεπόντη 'Θεωρία Μέτρου' -Εκδόσεις Συμμετρία (2005), τα Κεφάλαια 1,2,3,6,7,8,11 με έμφαση σε όσα έχουν διδαχθεί κατά τη διάρκεια του εξαμήνου.

Από το βιβλίο του Ι. Σπηλιώτη 'Στοχαστικές Διαφορικές Εξισώσεις και Εφαρμογές στα Χρηματοοικονομικά' -Εκδόσεις Συμεών 2004

1. Από το Κεφάλαιο I, οι παράγραφοι 1,2,3,4.
2. Από το Κεφάλαιο II, οι παράγραφοι 1,2.
3. Από το Κεφάλαιο III, οι παράγραφοι 1,2,3.
4. Από το Κεφάλαιο IV, οι παράγραφοι 1,2,3,4 χωρίς την απόδειξη του Θ. Αναπαράστασης Martigales.
5. Από το Κεφάλαιο V, οι παράγραφοι 1,2,3.

Η εξέταση θα γίνει με απαλλακτική εργασία που θα σταλεί στο e-class μία εβδομάδα πριν την ημερομηνία εξέτασης.