Simulación Numérica de Ecuaciones Diferenciales Estocásticas

Lucio Santi - lsanti@dc.uba.ar

Facultad de Ciencias Exactas y Naturales Universidad de Buenos Aires

3 de julio de 2017



Agenda

1 TBD

TBD

Gracias! Preguntas?

Referencias I



S. Asmussen and P. W. Glynn.

Stochastic Simulation: Algorithms and Analysis.

Stochastic Modelling and Applied Probability. Springer New York, 2007.



D. J. Higham.

An algorithmic introduction to numerical simulation of stochastic differential equations.

SIAM Rev., 43(3):525-546, Mar. 2001.



P. Kloeden and E. Platen.

Numerical Solution of Stochastic Differential Equations.

Stochastic Modelling and Applied Probability. Springer Berlin Heidelberg, 2011.