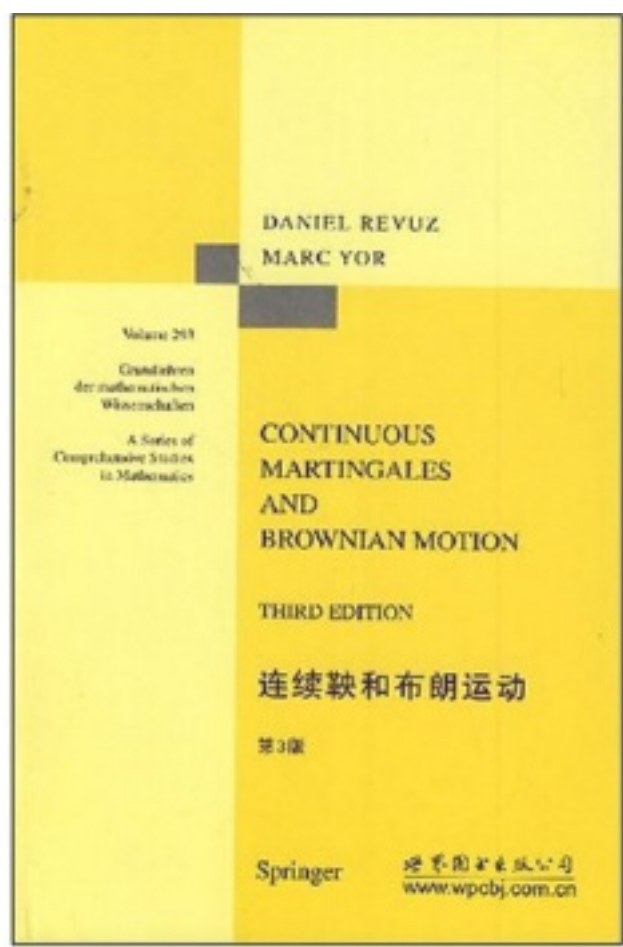


连续鞅和布朗运动



[连续鞅和布朗运动_下载链接1](#)

著者:瑞韦兹 (Revuz.D) 著

[连续鞅和布朗运动_下载链接1](#)

标签

评论

不错不错不错不错不错不错不错不错不错不错

喜欢读书的人……，喜欢收藏书的人，书买太多了。读不完……

不错的一本教材

同学推荐的教材啊，看了觉得不错！

不错的一本书，值得推荐一读。

好像很好的书很不错的建议推荐

虽然春哥国内影印版纸张都好烂。不过和正版的90多欧100多刀相比实在是太便宜了T____T。打印都比买书贵好么。买了就加油啃！！！><~~~~~

是一本关于随机过程比较专业的书。

很好~比起外国书真是便宜多了！是随机分析的上课用书~

好好好好好好

书很好，接下来需要详细读

很好，印刷质量不错，喜欢

连续鞅的经典教材，springer数学系列太强大了

开卷有益处,不忘送书人

随机分析好教材，适合做金融

不错！挺好

挺实用的，有一定帮助

很经典的书

鞅的原名 martingale

原指一类於18世纪流行於法国的投注策略，称为加倍赌注法（英语：Martingale (betting system)）。

[1]这类策略中最简单的一种策略是为博弈设计的。在博弈中，赌徒会掷硬币，若硬币正面向上，赌徒会赢得赌本，若硬币反面向上，赌徒会输掉赌本。这一策略使赌徒在输钱後加倍赌金投注，为的是在初次赢钱时赢回之前输掉的所有钱，同时又能另外赢得与最初赌本等值的收益。当赌徒的财产和可用时间同时接近无穷时，他掷硬币後硬币正面向上的概率会接近1，由此看来，加倍赌注法似乎是一种必然能赢钱的策略。然而，赌金的指数增长最终会导致使用这一策略的赌徒破产。

概率论中，鞅的概念是由保羅·皮埃爾·萊維（Paul Pierre Lévy）提出。鞅这个词本身，是来源于法国的一个叫马提克（Martique）的小镇，该小镇的居民以小气而著称。据说他们下周要花的一点小钱，估计起来最有可能等于他们今天花的钱。莱维正是从马提克小镇居民的小气习性中受到启发，创立了建立在最小气原理的数学概念之上的鞅方法的最初概念。而这一理论的初期基础理论的发展均是由约瑟夫·利奥·杜布（Joseph Leo Doob）完成。

完成这些工作的部分动机是为了表明成功的投注策略不可能存在。鞅是关于金融资产价格的最古老的模型，它起源于赌博业和概率论，若价格随机过程 $\{P(t+1)\}$ 满足下述条件：

$E(P(t+1) \mid P(t), P(t-1), \dots) = P(t)$ 也即是 $E(P(t+1) - P(t) \mid P(t), P(t-1), \dots) = 0$

则我们称价格随机过程 $\{P(t)\}$ 为鞅。 martingale

一类特殊的随机过程。起源于对公平赌博过程的数学描述。鞅为满足如下条件的随机过程：在已知过程在时刻 s 之前的变化规律的条件下，过程在将来某一时刻 t 的期望值等于过程在时刻 s 的值。例如，用 $Z(t)$ 表示某一赌徒在公平赌博中 t 时刻所拥有的本金，那么 $Z=\{Z(t), t \geq 0\}$ 为鞅，也就是说无论该赌徒在 s 时刻以后的赌博中如何利用他在 s 时刻之前所取得的经验，他所能期望在将来 t 时刻拥有的本金只能是 $Z(s)$ ，这正是“公平性”的体现。P. 莱维早在1935年就发表了一些孕育着鞅论的工作。1939年，莱维首次采用了鞅这个名称。但对鞅系统地进行研究并使它成为随机过程的一个重要分支的，则应归功于J.L. 杜布。鞅已成为研究随机过程的一个有力工具。

好

连续鞅和布朗运动》是一部很经典的讲述随机过程及布朗运动的教材（全英文版）。其旨在尽可能详细的向概率专家介绍尽可能多的有关布朗运动的观点、技巧和方法。自从1991年这《连续鞅和布朗运动》的第一版本问世以来，有关布朗运动和相关的随机过程一直是人们研究和讨论的热点。布朗运动是许多典型的概率问题连续鞅、高斯过程、马尔科夫过程甚至更特殊的具有独立增量的过程的交叉点。大量新的方法都能够成功的应用于它的研究，新的版本也就应运而生。《连续鞅和布朗运动》在第一章引入布朗运动后，以后的各章都是具体在讲述某一种特定的方法或者观点。在这些方法中贯穿于《连续鞅和布朗运动》始终的是随机积分以及强有力的游程理论。连续鞅和布朗运动》是一部很经典的讲述随机过程及布朗运动的教材（全英文版）。其旨在尽可能详细的向概率专家介绍尽可能多的有关布朗运动的观点、技巧和方法。自从1991年这《连续鞅和布朗运动》的第一版本问世以来，有关布朗运动和相关的随机过程一直是人们研究和讨论的热点。布朗运动是许多典型的概率问题连续鞅、高斯过程、马尔科夫过程甚至更特殊的具有独立增量的过程的交叉点。大量新的方法都能够成功的应用于它的研究，新的版本也就应运而生。《连续鞅和布朗运动》在第一章引入布朗运动后，以后的各章都是具体在讲述某一种特定的方法或者观点。在这些方法中贯穿于《连续鞅和布朗运动》始终的是随机积分以及强有力的游程理论。连续鞅和布朗运动》是一部很经典的讲述随机过程及布朗运动的教材（全英文版）。其旨在尽可能详细的向概率专家介绍尽可能多的有关布朗运动的观点、技巧和方法。自从1991年这《连续鞅和布朗运动》的第一版本问世以来，有关布朗运动和相关的随机过程一

直是人们研究和讨论的热点。布朗运动是许多典型的概率问题连续鞅、高斯过程、马尔科夫过程甚至更特殊的具有独立增量的过程的交叉点。大量新的方法都能够成功的应用于它的研究，新的版本也就应运而生。《连续鞅和布朗运动》在第一章引入布朗运动后，以后的各章都是具体在讲述某一种特定的方法或者观点。在这些方法中贯穿于《连续鞅和布朗运动》始终的是随机积分以及强有力的游程理论。

[连续鞅和布朗运动_下载链接1](#)

书评

[连续鞅和布朗运动_下载链接1](#)