

H. Pham, Université Paris VII, France



Optimisation et contrôle stochastique appliqués à la finance

L'objectif et l'originalité de ce livre est de présenter les différents aspects et méthodes utilisés dans la résolution des problèmes d'optimisation stochastique avec en vue des applications plus spécifiques à la finance: gestion de portefeuille, couverture d'options, investissement optimal. Nous avons inclus certains développements récents sur le sujet sans chercher a priori la plus grande généralité. Nous avons voulu une exposition graduelle des méthodes mathématiques en présentant d'abord les idées intuitives puis en énonçant précisément les résultats avec des démonstrations complètes et détaillées. Nous avons aussi pris soin d'illustrer chacune des méthodes de résolution sur de nombreux exemples issus de la finance. Nous espérons ainsi que ce livre puisse être utile aussi bien pour des étudiants que pour des chercheurs du monde académique ou professionnel intéressés par l'optimisation et le contrôle stochastique appliqués à la finance.... *more on <http://springer.com/978-3-540-73736-0>*

2007. XVI, 188 p. (Mathématiques et Applications, Vol. 61) Softcover

- ▶ **33,18 €**
- ▶ **\$49.95**
- ▶ **SFr. 51.50**
- ▶ **£29.99**

ISBN 978-3-540-73736-0

Order Now!

Yes, please send me _____ copies

"Optimisation et contrôle stochastique appliqués à la finance"
ISBN 978-3-540-73736-0

Methods of Payment Check/Money Order enclosed AmEx MasterCard VISA

Card No. Exp. Date

Please send orders to:

Outside the Americas:

Springer
Order Department
PO Box 2485
Secaucus, NJ 07096-2485
USA

Springer
Customer Service Center GmbH
Haberstrasse 7
69126 Heidelberg
Germany

- ▶ **Call toll-free** 1-800-SPRINGER
8:30 am – 5:30 pm ET
- ▶ **Fax your order to** (201) 348-4505
- ▶ **Web** springer.com
- ▶ **Email** orders-ny@springer.com

- ▶ **Call:** + 49 (0) 6221-345-4301
- ▶ **Fax:** +49 (0) 6221-345-4229
- ▶ **Web:** springer.com
- ▶ **Email:** orders-hd-individuals@springer.com

Name
Address
Street Address
(Sorry, we cannot deliver to P.O. boxes)
City / State / ZIP-Code
Country
Telephone / Email
Date ✕
Signature ✕

CA, MA, NJ, NY, and PA residents, please add sales tax. Canadian residents, please add 5% GST. Please add \$5.00 for shipping one book and \$1.00 for each additional book. Outside the US and Canada add \$10.00 for first book, \$5.00 for each additional book. All orders are processed upon receipt. If an order cannot be fulfilled within 90 days, payment will be refunded upon request. Prices are payable in US currency or its equivalent. Remember, your 30-day return privilege is always guaranteed. Pre-publication pricing: Unless otherwise stated, pre-pub prices are valid through the end of the third month following publication, and therefore are subject to change.

All € and £ prices are net prices subject to local VAT, e.g. in Germany 7% VAT for books and 19% VAT for electronic products. Pre-publication pricing: Unless otherwise stated, pre-pub prices are valid through the end of the third month following publication, and therefore are subject to change. All prices exclusive of carriage charges. Prices and other details are subject to change without notice. All errors and omissions excepted. Please consult springer.com for information on postage.