

عنوان		فارسی		حل عددی معادلات دیفرانسیل تصادفی				
درس		انگلیسی		Numerical Solution of Stochastic Differential Equations				
درس پیش نیاز	تعداد ساعت	تعداد واحد	نوع واحد					
			الزامی		اختیاری		جبرانی	
آنالیز عددی پیشرفته	۴۸	۳	عملی	نظری	عملی	نظری	عملی	نظری
			حل تمرین: ندارد					

هدف درس: در این درس دانشجویان با حسابان تصادفی و روش‌های عددی معادلات دیفرانسیل معمولی و جزئی تصادفی آشنا می‌شوند.

پیشنیازهای علمی لازم: دانشجو پیش از اخذ این درس لازم است با مقدمات احتمال و فرایند تصادفی و حل عددی معادلات دیفرانسیل معمولی و جزئی آشنا باشد و تسلط کافی به یکی از نرم افزارهای ریاضی مانند Matlab, Maple یا Mathematica داشته باشد.

ریز مطالب:

حسابان تصادفی: مقدمه ای بر نظریه احتمال و فرایندهای تصادفی، حرکت براونی و فرایند وینر و نوقه سفید، تقریب حرکت براونی، انتگرال تصادفی، انتگرال ایتو، فرمول ایتو، بسط تیلور تصادفی، همگرایی ضعیف و قوی.

معادله دیفرانسیل معمولی تصادفی: شبیه سازی مونت کارلو و تقریب های مسیری، روش اویلر-ساریاما، روش مایلستین، روش های رونگه-کوتا و نظریه درختان ریشه دار دو رنگی، شرایط مرتبه برای روش های رونگه-کوتا تصادفی، روش های چندگامی تصادفی، روش های تیلور ضعیف.

معادله دیفرانسیل جزئی تصادفی: روش تفاضل متناهی، روش اویلر-ساریاما، روش مایلستین، روش خطوط برای مسائل مقدار اولیه-سرری تصادفی، روش عناصر متناهی.

مراجع پیشنهادی

- 1- S. Cyganowski, P. Kloeden, J. Ombach (2002). **From Elementary Probability to Stochastic Differential Equations with Maple**, Springer.
- 2- I. Karatzas, S. E. Shreve (1991). **Brownian Motion and Stochastic Calculus**, Springer.
- 3- P. Kloeden, E. Platen (1995). **Numerical Solution of Stochastic Differential Equations**, Springer.
- 4- P. Kloeden, E. Platen, H. Schurz (2003). **Numerical Solution of SDE Through Computer Experiments**, Springer.
- 5- G. N. Milstein (1995). **Numerical Integration of Stochastic Differential Equations**, Springer.
- 6- A. Rößler (2003). **Runge-Kutta Methods for the Numerical Solution of SDEs**, Ph.D. Thesis.
- 7- A. Jentzen, P. Kloeden (2011). **Taylor Approximation for SPDEs**, SIAM.
- 8- G. Lord, C. Powell, T. Shardlow (2014). **An Introduction to Computational Stochastic PDEs**, Cambridge University Press.

