	UNINA9910300102003321
Autore	Wang Guangchen
Titolo	An Introduction to Optimal Control of FBSDE with Incomplete Information / / by Guangchen Wang, Zhen Wu, Jie Xiong
Pubbl/distr/stampa	Cham : , : Springer International Publishing : , : Imprint : Springer, , 2018
ISBN	3-319-79039-0
Edizione	[1st ed. 2018.]
Descrizione fisica	1 online resource (XI, 116 p.)
Collana	SpringerBriefs in Mathematics, , 2191-8198
Disciplina	532.5015192
Soggetti	Calculus of variations
	Probabilities
	Actuarial science
	Calculus of Variations and Optimal Control; Optimization
	Probability Theory and Stochastic Processes
	Actuarial Sciences
Lingua di pubblicazione	Inglese
Lingua di pubblicazione Formato	Inglese Materiale a stampa
Lingua di pubblicazione Formato Livello bibliografico	Inglese Materiale a stampa Monografia
Lingua di pubblicazione Formato Livello bibliografico Nota di contenuto	Inglese Materiale a stampa Monografia Introduction Filtering of BSDE and FBSDE Optimal Control of Fully Coupled FBSDE with Partial Information Optimal Control of FBSDE with Partially Observable Information LQ Optimal Control Models with Incomplete Information Appendix: BSDE and FBSDE.

1.

researchers in mathematics and engineering with basic knowledge of stochastic process, optimal control and mathematical finance.