

Irodalomjegyzék

- [1] Axelsson, O., *Iterative Methods for Large Linear Systems*. North Holland 1994.
- [2] Barucci, E., *Financial Markets Theory*. Springer, Berlin 2002.
- [3] Berde, É., Petró, K., A különféle hasznosságfogalmak szerepe a közgazdaságtanban. *Közgazdasági Szemle*, 1995, (5), 511–529.
- [4] Black, F. and Scholes, M., The pricing of options and corporate liabilities. *J. Polit. Econ.*, 1973, (81), 637–659.
- [5] Brealey, Myers, *Modern vállalati pénzügyek*. Panem, Budapest 1999.
- [6] Corless, R.M., *Essential Maple 7. An Introduction for Scientific Programmers*. 2nd. ed. Springer Verlag, New York 2002.
- [7] Cox, J. C., Ross, R. A., Rubinstein, M., Option pricing: a simplified approach. *J. Finan. Econ.*, 1979, (7), 229–263.
- [8] Demuth H., Beale, M., *Neural Network Toolbox. User's guide*. MathWorks, Natick, Massachusetts 2001.
- [9] Devroye, L., Györfi, L., Lugosi, G., *A Probabilistic Theory of Pattern Recognition*. Springer, New York 1996.
- [10] Farkas M., *Speciális függvények műszaki-fizikai alkalmazásokkal*. Műszaki Könyvkiadó, Budapest 1964.
- [11] Fazekas I. (szerkesztő), *Bevezetés a matematikai statisztikába*. Egyetemi jegyzet, KLTE, Debrecen 1997.
- [12] Gáll, J., Pap, G., *Opcióelmélet*. Jegyzet, Debreceni Egyetem, 2004, <http://mobidiak.inf.unideb.hu/mobi/listdocument.mobi?id=406>
- [13] Gáll, J., Pap, G., *Hasznosság alapú portfólió-menedzsment*. Jegyzet, Debreceni Egyetem, 2004, <http://mobidiak.inf.unideb.hu/mobi/listdocument.mobi?id=110>

- [14] Gahinet, P., Nemirovski, A., Laub, A.J., and Chilali, M., *LMI Control Toolbox for Use with Matlab*. The MathWorks, Natick, Massachusetts 1995.
- [15] Galántai A., Jeney A., *Numerikus módszerek. Egyetemi jegyzet*. Miskolci Egyetem 1997.
- [16] Godfrey, K.R., *Perturbation Signals for System Identification*. Prentice Hall, Englewood Cliffs 1993.
- [17] Golub, G.H., van Loan, C.F., *Matrix Computations*. John Hopkins University Press, Baltimore 1989 illetve 1996.
- [18] Gyurkovics, É., Takács T., Guaranteeing cost strategies for infinite horizon difference games with uncertain dynamics. (2004, közlésre benyújtva)
- [19] Hastie, T., Tibshirani, R., Friedman, J., *The Elements of Statistical Learning. Data Mining, Inference, and Prediction*. Springer, New York 2001.
- [20] Haykin, S., *Neural Networks. A Comprehensive Foundation*. Prentice Hall, Upper Saddle River, New Jersey 1999.
- [21] Huang, C.F., Litzenberger, R. H., *Foundations for Financial Economics*. Prentice Hall, Englewood Cliffs 1988.
- [22] Hull, J. C., *Options, Futures and other Derivatives*. Prentice Hall, London, 1997.
- [23] Kollár, I., On Frequency Domain Identification of Linear Systems. IEEE Trans. on Instrumentation and Measurement, 42, 1 (1993), 2–6.
- [24] Kuczmann M., MATLAB (5.rész), ELEKTRONet 2003/1, XII. évfolyam, 1. szám, 74–75.
- [25] Kuhn, H.W., The Hungarian Method for the Assignment Problem. Naval. Res. Logist. Quart., 2 (1955), 83–97.
- [26] *MATLAB External Interface Guide*. The MathWorks, Natick, Massachusetts 1993. (Unpublished)
- [27] *Matlab Reference Guide*. The MathWorks, Natick, Massachusetts 1993. (Unpublished)
- [28] Moler, C., *Numerical Computing with Matlab*. SIAM Books, Philadelphia 2004.
- [29] Molnárka Gy., Gergó L., Wettl F., Kallós F., Horváth A., *A Maple V és alkalmazásai*. Springer Hungarica, Budapest 1996.
- [30] Nemirovski, A., Gahinet, P., The projective method for solving linear matrix inequalities. Proc. Amer. Contr. Conf., 1994, 840–844.
- [31] Nesterov, Yu., Nemirovski, A., *Interior Point Polynomial Methods in Convex Programming: Theory and Applications*. SIAM Books, Philadelphia 1994.

- [32] Pärt-Enander, E. et al., *The MATLAB Handbook*. Addison-Wesley, Harlow 1996.
- [33] Pintelon, R., Schoukens, J., Identification of Continuous-Time Systems Using Arbitrary Signals. *Automatica*, 33, 5 (1997), 991–94.
- [34] Pintelon, R., Schoukens, J., *System Identification: A Frequency Domain Approach*. IEEE Press, 2001.
- [35] Pintelon, R., Schoukens, J. and Vandersteen, G., Frequency Domain System Identification Using Arbitrary Signals. *IEEE Trans. Autom. Contr.*, AC-42, 12 (1997), 1717–20.
- [36] Pintelon, R., Guillaume, P., Rolain, Y., Schoukens, J., and Van hamme, H., Parametric Identification of Transfer Functions in the Frequency Domain, a Survey. *IEEE Trans. Autom. Control*, AC-39, 11 (1994), 2245–60.
- [37] Press, W.H., Flannery, B.P., Teukolsky, S.A., and Vetterling, W.T., *Numerical Recipes: The Art of Scientific Computing*. Cambridge University Press, Cambridge 1986.
- [38] Rolain, Y., Pintelon, R., Xu, K.Q., and Vold, H., Best Conditioned Parametric Identification of Transfer Function Models in the Frequency Domain. *IEEE Trans. Autom. Contr.*, AC-40, 11 (1995), 1954–60.
- [39] Rózsa P., *Lineáris algebra és alkalmazásai*. 6. kiadás. Tankönyvkiadó, Budapest 1991.
- [40] Schoukens, J., Dobrowiecki, T., and Pintelon, R., Parametric Identification of Linear Systems in the Presence of Nonlinear Distortions: A Frequency Domain Approach. *IEEE Trans. Autom. Contr.*, AC-43, 2 (1998), 176–90.
- [41] Schoukens, J., Pintelon, R., *Identification of Linear Systems – A Practical Guideline for Accurate Modeling*. Pergamon Press, London 1991.
- [42] Shampine, L.F., Reichelt, M.W., The MATLAB ODE Suite, *SIAM J. Sci. Comp.*, 18-1, 1997.
- [43] Stoyan G., Takó G., *Numerikus módszerek I, 2. kiadás*. Typotex, Budapest 2002.
- [44] Stoyan G., Takó G., *Numerikus módszerek II*. Typotex, Budapest 1995.
- [45] Stoyan G., Takó G., *Numerikus módszerek III*. Typotex, Budapest 1997.
- [46] Szili L., Tóth J., *Matematika és Mathematica*. ELTE-Eötvös kiadó, Budapest 1996.
- [47] The MathWorks, *Using MATLAB Version 5., revised for MATLAB 5.1*. Natick, Massachusetts 1997.
- [48] The MathWorks, *Building a Graphical User Interface*. Natick, Massachusetts 1993.

-
- [49] Vapnik, V.N., *Statistical Learning Theory*. Wiley Interscience, New York 1998.
- [50] van der Vorst, H.A., A fast and smoothly converging variant of BICG for the solution of nonsymmetric linear systems. *SIAM J. Sci. Stat. Comp.*, 13 (1990), 631–644.