

SEMINÁRIO DE SISTEMAS DINÂMICOS

Uma introdução à integração estocástica

Luis R. Lucinger

MAT/UnB

04/05/17 (quinta-feira)

14:00 Horas

Auditório do MAT

Resumo. Nesta palestra, introduziremos a integração estocástica com relação ao movimento Browniano e apresentaremos a fórmula de Itô neste contexto.

Referências

- [1] Kuo, Hui-Hsiung. *Introduction to Stochastic Integration*. Universitext. Springer, 2005.
- [2] Sondermann, Dieter. *Introduction to stochastic calculus for finance: a new didactic approach*. Springer, 2008.