

SEMINÁRIO DE SISTEMAS DINÂMICOS

Uma introdução à integração estocástica via processos de Lévy

Paulo Henrique

MAT/UnB

12/05/17 (sexta-feira)

11:00 Horas

Miniauditório do MAT (AT-427/08)

Resumo. Nesta palestra, introduziremos a integração estocástica com relação a processos de Lévy. Essa é uma generalização natural da integração de Itô para processos com saltos. Apresentaremos a fórmula de Itô a qual fornece uma ideia dos tipos de problemas em dinâmica que se estuda nesse contexto.

Referências

- [1] Applebaum, D. *Lévy Processes and Stochastic Calculus*. Cambridge Studies in Advanced Mathematics. Cambridge University Press, 2004.