

SEMINÁRIO DE PROBABILIDADE

Análise Estocástica via Bases de Lévy

Ary Vasconcelos Medino

Universidade de Brasília

22/9/2017

14:15 Horas

Miniauditório do MAT

Resumo Neste seminário, estudaremos o conceito de Base de Lévy. Apresentaremos seus elementos característicos tais como medida de controle, quádrupla característica e "Lévy seed". O assunto será ilustrado através dos exemplos de base de Lévy-Poisson, base de Lévy Gaussiana, base de Lévy-gama e base de Lévy-Normal Inversa. A noção de Integral estocástica com respeito a bases de Lévy será discutida e um critério de integrabilidade será apresentado. Este é um trabalho em conjunto com Sílvia R. C. Lopes do Instituto de Matemática da UFRGS.

Bibliografia

- [1] Barndorff-Nielsen, O.E. (2011). "Stationary infinitely divisible processes". *Brazilian Journal of Probability and Statistics*, Vol. 25(3), 294-322.
- [2] Barndorff-Nielsen, O.E., F.E. Benth and A.E.D. Veraart (2011). "Ambit Processes and Stochastic Partial Differential Equations". In: *Advanced Mathematical methods for Finance*, G. Di Nunno and B. Oksendal (eds.), 32-74. Berlin: Springer-Verlag.
- [3] Rajput, B. and J. Rosinski (1989). "Spectral representation of infinitely divisible distributions". *Probability Theory and Related Fields*, Vol. 82, 451-487.
- [4] Walsh, J. (1986). "An introduction to stochastic partial differential equations". In: R. Carmona, H. Kesten and J. Walsh (eds.), *Lecture Notes in Mathematics*, Vol. 1180, École d'Été de Probabilités de Saint-Flour XIV- 1984. Berlin: Springer, 265-439.