

# SEMINÁRIO DE SISTEMAS DINÂMICOS

## Cálculo estocástico descomplicado

**Luis Lucinger**  
UnB

20/10/17  
10:00 h

Mini Auditório do MAT

**Abstract.** Nesta palestra, introduziremos de maneira simplificada alguns conceitos do cálculo estocástico. A ideia é demonstrar a fórmula de Ito (utilizando somente conteúdos de análise na reta), apresentar a integração estocástica de Ito bem como algumas equações diferenciais estocásticas e suas soluções via fórmula de Ito.

## Referências

- [1] D. Sondermann - Introduction to stochastic calculus for finance. Springer.