

SEMINÁRIO DE PROBABILIDADE

Variação Quadrática do Movimento Browniano

Felipe Sousa Quintino

Universidade de Brasília

27/10/2017

14:15 Horas

Miniauditório do MAT

Resumo. Neste seminário discutiremos resultados sobre a variação quadrática do movimento Browniano e apresentaremos algumas de suas aplicações. Destacaremos como a teoria de Martingales Reversas é uma ferramenta fundamental para a demonstração da existência quase certa desta variação.

Bibliografia

- [1] Hida, I. . Brownian Motion. Applications of Mathematics, 11. Springer-Verlag, 1980
- [2] Klebaner, F. C.. Introduction to Stochastic Calculus with Applications. Imperial College Press. 2005.
- [3] Breiman, L. . Probability. Addison-Wesley, 1968.
- [4] Loeve, M. . Probability Theory II. Springer-Verlag, 1978.