

SEMINÁRIO DE PROBABILIDADE

Teoremas Fundamentais das Finanças Matemáticas

Wenersamy Ramos de Alcântara

Universidade de Brasília

24/11/2017

14:15 Horas

Miniauditório do MAT

Resumo. Neste seminário será discutida a intrínseca relação entre a teoria de martingales e o conceito de ausência de arbitragem em mercados financeiros, com a apresentação de um panorama geral da evolução teórica estimulada por essa relação, dos Teoremas Fundamentais da Precificação de Ativos que a formalizam, bem como sua aplicação na precificação de ativos contingentes.