

SEMINÁRIO DE PROBABILIDADE

Elementos de Modelagem Matemática em Mercados Financeiros.**Ary Vasconcelos Medino**

Departamento de Matemática Universidade de Brasília

02/09/2022, Brasília

Horário: 2:15 pm

Local : Miniauditório Sala A

Abstract. Esta palestra tem o objetivo de ilustrar como a teoria da Integração Estocástica de Itô e das Equações Diferenciais Estocásticas fornecem um arcabouço para a modelagem estocástica de mercados financeiros, ramo da Teoria da Probabilidade conhecido como Finanças Matemática. A apresentação tem um caráter introdutório de divulgação e para tal, as pesadas technicalidades matemáticas inerentes ao assunto serão minimizadas.

References

- [Cont] Cont, R. and Tankov, P. (2004), Financial Modeling with Jump Processes, Chapman & Hall/CRC.
- [Duffie] Duffie, D. (1988), Security Markets: Stochastic Models, Academic Press.
- [Karat] Karatzas, I. and Shreve, S. E. (1998), Brownian Motion and Stochastic Calculus, Springer.
- [Kuo] Kuo, H-H. (2006), Introduction to Stochastic Integration, Springer.
- [Osk] Øksendal, B. Stochastic Differential Equations. 5th edition, Springer, 2000