

1ª AULA 19 Mar 2010 17.00 - 20:00

Cálculo Financeiro Avançado

Equações Diferenciais Estocásticas e Aplicações

Equações Diferenciais Estocásticas e Aplicações Biológicas

0. Apresentação, programa, bibliografia, métodos e datas de avaliação.

Módulo 1- Introdução às equações diferenciais estocásticas e aplicações
Comum (e com aulas comuns) às unidades curriculares de Cálculo Financeiro Avançado (MMEAD, MEMF, PDG), de Equações Diferenciais Estocásticas e Aplicações (MMA, PDM) e de Equações Diferenciais Estocásticas e Aplicações Biológicas (MMEAD)

1. Introdução histórica

2. Introdução informal às equações diferenciais estocásticas

Modelo de Black-Scholes e processo de Wiener (movimento browniano). Ruído branco.