FITXA IDENTIFICATIVA

Dades de l'Assignatura

Codi	42218
Nom	Processos estocàstics (ampliació)
Cicle	Màster
Crèdits ECTS	6.0
Curs acadèmic	2024 - 2025

Titulació/titulacions

Titulació	Centre	Curs	Període
2081 - Màster Universitari en Banca i Finances Quantitatives	Facultat d'Economia	2	Anual

Matèries

Titulació	Matèria	Caràcter
2081 - Màster Universitari en Banca i Finances Quantitatives	2 - Matèries optatives	Optativa

Coordinació

Nom	Departament
TORRO I ENGUIX, HIPOLIT	113 - Economia Financera i Actuarial

RESUM

CONEIXEMENTS PREVIS

Relació amb altres assignatures de la mateixa titulació

No heu especificat les restriccions de matrícula amb altres assignatures del pla d'estudis.

Altres tipus de requisits

COMPETÈNCIES (RD 1393/2007) // RESULTATS DE L'APRENENTATGE (RD 822/2021)

RESULTATS D'APRENENTATGE (RD 1393/2007) // SENSE CONTINGUT (RD 822/2021)

DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS

1.

2.

3.

4.

5.

6.

VOLUM DE TREBALL

ACTIVITAT	Hores	% Presencial
Classes de teoria	60,00	100
TOTAL	**60,00**	

METODOLOGIA DOCENT

AVALUACIÓ

REFERÈNCIES

Bàsiques

- La referencia principal es el libro

  Shreve, S. (2000): Stochastic Calculus for Finance. Cambridge.

  Sin embargo, hay temas preparados con material de los siguientes libros:

Applebaum, D. (2004): Lèvy Processes and Stochastic Calculus. Cambridge.
Apostol, T. (1974): Mathematical Analysis, 2nd Edition. Addison-Wesley.
Ash, R. (1972): Measure, Integration and Functional Analysis. Academic Press.
Cont, R. and P. Tankov (2004): Financial Modelling With Jump Processes. Chapman and Hall
Durret, R. (1999): Essentials of Stochastic Processes. Springer.
Davidson, J. (1994): Stochastic Limit Theory. Oxford.
Lamberton, D. And B. Lapeyre (1996): Introduction to Stochastic Calculus applied to finance. Chapman & Hall.
Mikosch, T. (1998): Elementary Stochastic Calculus. World Scientific.
Munroe, M. (1953): Measure and Integration. Addison-Wesley.
Ross, S. (1996): Stochastic Processes. Wiley.
Schilling, R. (2005): Measures, Integrals and Martingales. Cambridge.
Steele, JM (2000): Stochastic Calculus and Financial Applications. Springer.