

Primera parte – 16 sesiones

Febrero: 16 y 23

Marzo: 2, 9, 16 y 23

Abril: 6, 13, 20 y 27

Mayo: 4, 11, 18 y 25

Junio: 1 y 8

TEMARIO

01. Repaso general de Teoría de la Medida.
02. Repaso general de Teoría de la Probabilidad.
03. Teorema de consistencia de Kolmogorov.
04. Construcción del proceso de Wiener.
05. Esperanza condicional.
06. Procesos estocásticos.
07. Tiempos de paro opcionales.
08. Tiempos de paro previsibles.
09. Medida generada por un proceso no decreciente.
10. Martingalas en tiempo discreto.
11. Martingalas en tiempo continuo.
12. La integral de Ito.
13. Ecuaciones integrales estocásticas.
14. Aplicación a Finanzas.

Segunda parte – 16 sesiones

Agosto: 10, 17, 24 y 31

Septiembre: 7, 14, 21 y 28

Octubre: 5, 12, 19 y 26

Noviembre: 9, 16, 23 y 30

TEMARIO

10. La σ -álgebra previsible.
11. Proceso no decreciente asociado a una Martingala acotada en L^2 .
12. Integrales estocásticas con respecto a una Martingala.
13. Integrales estocásticas con respecto a una Martingala Local.
14. Semimartingalas.
15. Fórmula de Ito.