

Oferta de TFG, Curso 2017-18

Santiago Carrillo

1. Movimiento browniano:

1. Objeto: principales propiedades de las trayectorias del browniano; cálculo de Ito de manera intuitiva.
2. Bibliografía:
 1. Dynamical theories of brownian motion; E. Nelson
(https://www.google.es/url?sa=t&rct=j&q=&esrc=s&source=web&cd=1&cad=rja&uact=8&ved=0CCcQFjAA&url=https%3A%2F%2Fweb.math.princeton.edu%2F~nelson%2Fbooks%2Fbmotion.pdf&ei=XEuJVY3PD8X-UPOLg8AC&usg=AFQjCNG6lCu64TVGeupp7ePBjyK4Dv_bXw&sig2=YxiSpV6QpfBLvDFerXnQyA&bvm=bv.96339352,d.d24).
 2. Stochastic Integral; Mc Kean.

2. Opciones americanas y ecuaciones en derivadas parciales:

1. Objeto: estudiar la relación entre los aspectos probabilísticos y de Ecuaciones en derivadas parciales en la valoración de una opción americana (tiempo continuo).
2. Bibliografía: Paul Wilmott, Derivatives. T Shreve: financial Mathematics.