

**FICHA IDENTIFICATIVA****DATOS DE LA ASIGNATURA****Código:** 42202**Nombre:** Procesos estocásticos**Ciclo:** Máster Universitario Oficial**Créditos ECTS:** 4**Curso académico:** 2025-26**TITULACIONES**

Titulación	Centro	Curso	Periodo
2081 - Máster Universitario en Banca y Finanzas Cuantitativas	Facultat d'Economia	1	Anual

**MATERIAS**

Titulación	Materia	Carácter
2081 - Máster Universitario en Banca y Finanzas Cuantitativas	Materias obligatorias	OBLIGATORIA

**COORDINACIÓN**

CARCHANO ALCINA OSCAR

**RESUMEN**

Los objetivos específicos de la asignatura de procesos estocásticos son:

1. Estructurar y ejercitar problemas de probabilidad, probabilidad condicionada y mezcla de distribuciones.
2. Definir y clasificar los procesos estocásticos.
3. Estudiar propiedades básicas de martingalas.
4. Estudiar en detalle el Movimiento browniano.
5. Familiarizarse con las propiedades del cálculo estocástico.
6. Aplicar adecuadamente la regla de cálculo estocástico de Itô.
7. Ser capaz de simular, presentar e interpretar los resultados mediante MatLab o software similar.

**CONOCIMIENTOS PREVIOS**



## RELACIÓN CON OTRAS ASIGNATURAS DE LA MISMA TITULACIÓN

No se han especificado restricciones de matrícula con otras asignaturas del plan de estudios.

## OTROS TIPOS DE REQUISITOS

Relación con otras asignaturas de la misma titulación:

Los estudiantes provienen habitualmente de grados diferentes, en su mayoría de Economía, ADE, Matemáticas y Físicas. Eso significa que se suele configurar un grupo heterogéneo. Esta asignatura se imparte en el primer año de master (este master es de 120 ECTS), en el segundo trimestre. Para entonces los estudiantes han recibido tres asignaturas que han servido para que todos tengan un nivel básico común (Matemáticas y Estadística, Economía y Fundamento

## COMPETENCIAS / RESULTADOS DE APRENDIZAJE

## DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS

### 1. Tema 1. Variables aleatorias, Teorema Central del Límite. Distribuciones condicionadas

- Probabilidad y variables aleatorias
  - o Espacios de probabilidad
  - o Variables aleatorias
  - o Esperanza matemática y funciones asociadas
  - o Independencia y probabilidad condicionada
  - o Desigualdades y tipos de convergencia

- Mezcla de distribuciones
  - o Convolución de variables
  - o Distribuciones compuestas
  - o Esperanzas iteradas

### 2. Tema 2. Procesos Estocásticos, definición y clasificación. Ejemplos

- Introducción
  - o Distribuciones marginales. Teorema de Kolmogorov
  - o Características de un proceso
  - o Criterio de continuidad

- Cadenas de Markov
  - o Matrices estocásticas y definición de cadena de Markov
  - o Clasificación de estados de una cadena
  - o Recurrencia y transitoriedad
  - o Comportamiento asintótico: distribuciones estacionarias

- Procesos de Poisson
  - o Procesos con saltos



- Procesos estacionarios
- o Procesos ARMA
  - o Procesos ergódicos

- Martingalas
- o Paseo aleatorio

### 3. Tema 3. Movimiento browniano. Cálculo de Ito

- o Definición
- o Propiedades

Integrales estocásticas

- o Construcción
- o Representación integral de variables aleatorias
- o Representación integral de martingalas

Cálculo de Itô

- o Cálculo diferencial estocástico. Regla de Itô
- o Cambio de probabilidad. Teorema de Girsanov
- o Modelo de Black-Scholes

## VOLUMEN DE TRABAJO (HORAS)

### ACTIVIDADES PRESENCIALES

Actividad	Horas
Teoría	20,00
Aula informática	20,00
<b>Total horas</b>	<b>40,00</b>

### ACTIVIDADES NO PRESENCIALES

Actividad	Horas
Asistencia a otras actividades	0,00
Elaboración de trabajos individuales o en grupo	0,00
Estudio y trabajo autónomo	0,00
Preparación de clases	0,00
Preparación de actividades de evaluación	0,00
Resolución de casos prácticos	0,00
<b>Total horas</b>	<b>0,00</b>

## METODOLOGÍA DOCENTE



Clases teóricas y prácticas de aula y con ordenador. Todas ellas interactivas. Es importante que los estudiantes traten de resolver los problemas sin conocer previamente la solución. Pueden comenzar abordando los problemas en grupo, pero deben combinar el trabajo en grupo con el esfuerzo personal.

Esta forma combinada es la forma de adquirir la competencia de poder enfrentarse a nuevos problemas con los instrumentos técnicos adquiridos.

## EVALUACIÓN

La evaluación se basa en relaciones de ejercicios a entregar periódicamente (aproximadamente cada dos semanas) y en un examen final.

Este método permite que el alumno vaya realizando el aprendizaje de forma continua, conozca sus fallos y los corrija, y de forma definitiva realice un examen final que certifique el conocimiento adquirido durante el curso. De hecho, es habitual que repitan tareas si estas no han sido realizadas de forma adecuada la primera vez.

La valoración final se realizará en función de la nota del examen y de las tareas. Se requiere un mínimo de 5 puntos en el examen para poder compensar con las tareas. De forma general, unas tareas bien realizadas podrán aumentar un nivel la calificación del examen (Aprobado a Notable, Notable a Sobresaliente y Sobresaliente a Matrícula de Honor). En todo caso es necesario haber entregado las tareas para aprobar la asignatura.

El tipo de materia y el tamaño del grupo permite un seguimiento individualizado, de forma que habitualmente, y esto es algo que los estudiantes aprecian, si los estudiantes resuelven en su mayor parte las tareas por sí mismos, no tienen ningún problema para superar la asignatura

## BIBLIOGRAFÍA

- Grimmet, G. and D. Stirzaker, Probability and Random Processes, Oxford University Press, 2001. -  
Karatzas, I. and S. Shreve, Brownian Motion and Stochastic Calculus, Springer-Verlag, 1991. -  
Lamberton, D. and B. Lapeyre, Stochastic Calculus Applied to Finance, Chapman and Hall, 1996



- Notas de Procesos Estocásticos, de David Nualart y Eva Ferreira - 89 Problemas resueltos de Probabilidad, Procesos estocásticos y Cálculo de Itô. Eva Ferreira y Larraitz Aranburu.