VNIVERSITAT DE VALÈNCIA

Guia Docent

42218 Processos estocàstics (ampliació)

FITXA IDENTIFICATIVA

DADES DE L'ASSIGNATURA

Codi: 42218
Nom: Processos estocàstics (ampliació)
Cicle: Màster Universitari Oficial
Crèdits ECTS: 6
Curs acadèmic: 2025-26

TITULACIONS

Titulació	Centre	Curs	Periode
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	Matèries optatives	OPTATIVA

COORDINACIÓ

CARCHANO ALCINA OSCAR

RESUM

CONEIXEMENTS PREVIS

RELACIÓ AMB ALTRES ASSIGNATURES DE LA MATEIXA TITULACIÓ

No s'ha especificat restriccions de matrícula amb altres assignatures del pla d'estudis.

ALTRES TIPUS DE REQUISITS

COMPETÈNCIES / RESULTATS D' APRENENTATGE

DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS

1.

2.

3.

4.

5.

6.

VOLUM DE TREBALL (HORES)

ACTIVITATS PRESENCIALS

Activitat	Hores
Teoria	30,00
Pràctiques a l'aula	15,00
Aula informàtica	15,00
Total hores	**60,00**

ACTIVITATS NO PRESENCIALS

Activitat	Hores
Assistència a altres activitats	0,00
Elaboració de treballs individuals o en grup	0,00
Estudi i treball autònom	0,00
Preparació de classes	0,00
Preparació d'activitats d'avaluació	0,00
Resolució de casos pràctics	0,00
Total hores	**0,00**

METODOLOGIA DOCENT

AVALUACIÓ

BIBLIOGRAFIA

- 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.