

**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	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	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 Durrett, 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.