

Mestrado em Matemática Financeira

Cálculo Estocástico

Lista de Exercícios - 3  
2014

Resolva os seguintes exercícios do livro de B. Oksendal, "Stochastic Differential Equations: An Introduction with Applications", 6th. Edition, Springer, 2003:

- 5.1.
- 5.2.
- 5.4.
- 5.5.
- 5.6.
- 5.7.
- 5.9.
- 5.11.
- 5.16.
- 7.1.
- 7.2.
- 8.2.
- 8.5.
- 8.6.