

Mestrado em Matemática Financeira

Cálculo Estocástico

Lista de Exercícios - 1
2014

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

- 2.13.
- 2.14.
- 2.16.
- 3.1.
- 3.3.
- 3.4.
- 3.5.
- 3.6.
- 3.12.
- 3.15.
- 4.1.
- 4.2.
- 4.3.
- 4.5.
- 4.6.
- 4.8.
- 4.11.
- 4.14.
- 4.15.