

EL TEOREMA FUNDAMENTAL DE LA TEORÍA DE PRECIOS

MARÍA PILAR SILVESTRE
(UB)

El seminario es una breve introducción a la Teoría de Arbitraje. En un primer momento se estudiará su teorema fundamental en su versión más sencilla: conjunto de estados finito y espacio tiempo finito discreto. A continuación se estudiará el teorema fundamental de la teoría de precios para un proceso estocástico de tiempo finito discreto. Se finalizará con el estudio del Teorema de Dalang, Morton, Willinger para procesos estocásticos generales.