

Um Passeio pelo Mundo das Finanças Quantitativas

Vinícius Viana Luiz Albani
Departamento de Matemática
Universidade Federal de Santa Catarina

Resumo: Nesta palestra veremos o modelo de mercado completo que é usado amplamente em finanças quantitativas para a precificação de contratos derivativos, que por sua vez são usados para a mitigação de risco. Neste contexto serão apresentados alguns resultados fundamentais, como o Teorema de Completude dos Mercados e o Teorema de Girsanov.