



UNIVERSIDADE FEDERAL DA PARAÍBA
CENTRO DE CIÊNCIAS EXATAS E DA NATUREZA
DEPARTAMENTO DE MATEMÁTICA

CONCURSO PÚBLICO PARA PROFESSOR DE 3º GRAU, CLASSE ADJUNTO.

ÁREA: PROBABILIDADES

PONTOS DO CONCURSO (RECORTAR)

1. O movimento Browniano - Propriedades básicas;

2. Fórmula de Ito;

3. Teorema de representação martigale;

4. Martingales - Propriedades básicas;

5. Integração estocástica;

6. Teorema de Girsanov;

7. Equações diferenciais estocásticas;

8. Fórmula de Feynman Kac;

9. Derivada de Malliavin;

10. Integral de Skorohod.