

O seminário terá como foco um estudo dos temas principais tratados pelo Prof. David Nualart em seu curso “Malliavin calculus and normal approximations” (notas da 23ª EBP) onde são apresentados elementos básicos do cálculo de Malliavin e discutem-se aplicações a estimativas em aproximações pela distribuição normal.

Referências:

D. Nualart. *Malliavin calculus and normal approximations*. Ensaios Matemáticos, Volume 34, 1–74, (2019)

D. Nualart and E. Nualart. *Introduction to Malliavin Calculus*. Institute of Mathematical Statistics Textbooks, Cambridge University Press, 2018

D. Nualart and G. Peccati. *Central limit theorems for sequences of multiple stochastic integrals*. The Annals of Probability 33, pp. 177-193, (2005).

I. Nourdin and G. Peccati. *Normal approximations with Malliavin calculus: from Stein’s method to universality*. Cambridge tracts in Mathematics 192, Cambridge University Press, 2012.

Horário: 6as feiras, 15:30 às 17:30.