



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

E-mail: chefia@mat.ufpb.br

Telefone: (83) 3216-7434

**CONCURSO PÚBLICO DE PROVAS E TÍTULOS PARA PROFESSOR DO
MAGISTÉRIO SUPERIOR, NA ÁREA DE **PROBABILIDADE**.**

Edital Nº 62, de 23 de maio de 2016, publicado no *Diário Oficial da União* no dia 25 de maio de 2016.

I. CONTEÚDO PROGRAMÁTICO PARA A PROVA DIDÁTICA

1. O movimento Browniano - Propriedades básicas;
2. Fórmula de Ito;
3. Teorema de representação martingale;
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.

II. CALENDÁRIO DE PROVAS

De 15 a 19 de agosto de 2016

Segunda – 15/08	Terça – 16/08	Quarta – 17/08	Quinta – 18/08	Sexta – 19/08
- Às 08h00 Sorteio do tema da prova escrita - Às 08h10 Prova Escrita - Correção da prova escrita - Resultado da prova escrita	- Sorteio do tema da prova didática	- Prova didática	- Defesa do plano de trabalho	- Prova de títulos - Relatório Conclusivo

III. LOCAL DE PROVAS

Sala de Reuniões do Departamento de Matemática
Centro de Ciências Exatas e da Natureza
UFPB – Campus I – João Pessoa - PB

III. COMISSÃO EXAMINADORA

TITULARES:

Dr. Alberto Ohashi- UFPB
Dr. Paulo Ruffino - UNICAMP
Dr. Édson Alberto Coayla Teran - UFBA

SUPLENTE:

Dr. Alexandre Simas - UFPB
Dr. Dorival Leão – USP
Dr. Pedro Catuogno - UNICAMP