

# LA INTEGRAL DE ITO

Jonathan Farfán

*Pontificia Universidad Católica del Perú.*

## Resumen

El objetivo principal de este minicurso es exhibir de manera explícita los pasos de la construcción de la integral de Ito en el caso en que el integrador es un Movimiento Browniano y luego ver los pasos de la construcción con integradores más generales. Para tal fin, serán necesarios introducir algunos conceptos previos tales como: tipos de convergencia de variables aleatorias, tiempos de parada, Movimiento Browniano y martingalas.