



**UNIVERSIDAD CATOLICA
DE LA SANTISIMA CONCEPCION**

**SEMINARIO DEL DEPARTAMENTO DE
MATEMÁTICA Y FÍSICA APLICADAS**

FACULTAD DE INGENIERÍA

**“Fractional Brownian motion and long
memory processes: from Finance to
Hydrology”**

Dr. Jorge Clarke de la Cerda

Universidad del Bío Bío

Viernes 06 de Junio de 2014

15:30 horas

Auditorio Santa Teresa Jesús de Ávila

**Facultad de Comunicación, Historia y Ciencias Sociales -
UCSC**

Resumen:

Esta exposición presentará de forma introductoria y motivacional el uso de procesos estocásticos de larga memoria en diferentes contextos de modelación, desde el desarrollo histórico que han tenido estos objetos hasta los trabajos que el autor ha desarrollado. En particular se definirá lo que es un movimiento Browniano fraccionario y se expresarán también los conceptos de autosimilaridad y dependencia de largo rango.

Coordinadores: Jessika Camaño, Departamento de Matemática y Física Aplicadas, Of. 29.
Patricio Montenegro, Departamento de Matemática y Física Aplicadas, of . 56.