
PROGRAMA DE VERÃO 2023 - 709

ESCOLA DE MATEMÁTICA APLICADA FGV EMap

DISCIPLINA: Mean Field Games with Applications

PROFESSOR: Sebastian Jaimungal

CARGA HORÁRIA: 06

PRÉ-REQUISITO:

PERÍODO: 06/02/2023 a 10/02/2023

HORÁRIO: 10h às 12horas

PLANO DE ENSINO

1. Ementa

Mean field games (MFGs) is a methodology that allows one to approximate large finite player games. This course will introduce the basic concepts and methods in MFGs, and look at a few applications and numerical examples in finance, including algorithmic trading and systemic risk.

2. Procedimentos de avaliação

Não será aplicado avaliação durante o curso.

3. Bibliografia Obrigatória

4. Mini Currículo

