

11ª AULA 2 Jul 2010 17.00 - 20:00

Cálculo Financeiro Avançado (última aula)

Equações Diferenciais Estocásticas e Aplicações (haveria módulo suplementar mas faltaram alunos)

Módulo 2 - Aplicações financeiras de EDE

Comum (e com aulas comuns) às unidades curriculares de Cálculo Financeiro Avançado (MMEAD, MEMF, PDG) e de Equações Diferenciais Estocásticas e Aplicações (MMA, PDM)

Nota: Na disciplina de Equações Diferenciais Estocásticas e Aplicações Bilógicas, os alunos inscritos deixaram de aparecer, pelo que não se realizaram as respectivas aulas

10. Opções

Opções europeias e americanas de compra e venda e relações entre elas. Opções europeias de compra: dedução da fórmula de Black-Scholes pela fórmula de Feynman-Kac, carteira replicante, interpretação e exercícios de aplicação.

Teorema de Girsanov.

Opções europeias de compra: dedução da fórmula de Black-Scholes pelo teorema de Girsanov, carteira replicante, interpretação e exercícios de aplicação. Volatilidade histórica e volatilidade implícita. Os "greeks". O modelo de Cox-Ross-Rubinstein. Generalização a modelos gerais com vários activos financeiros.