

9ª AULA 18 Jun 2010 17.00 - 20:00

Cálculo Financeiro Avançado

Equações Diferenciais Estocásticas e Aplicações

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

8. Estudo detalhado do modelo de Black-Scholes:

Continuação do estudo detalhado, incluindo estimação e previsão.

Solução por conversão numa equação de Stratonovich equivalente e uso das regras usuais de cálculo.

Simulação de trajectórias para EDE gerais.

Comportamento assintótico das trajectórias do modelo de Black-Scholes.

9. Difusões de Itô unidimensionais

Modelo de Vasicek. Outros modelos de taxas de juro e de taxas de câmbio. Exercícios.