LISTA DE EXERCÍCIOS PRÁTICOS nº 2
Entregar até 2/08/2004

Considere uma opção de compra européia com preço de exercício $R\$$ 105 e maturação em 8 meses sobre uma ação cujo preço atual é 100. Considere ainda que a taxa de juros livre de risco é de 10% aa, e que o preço atual desta opção é $R\$ \ 7,50$.

Questão 1 *Calcule a volatilidade implícita usando algum dos métodos abaixo, escolhido de acordo com a inicial do seu (primeiro) nome:*
A-C: Método da Bissecção
D-H: Método Regula Falsi
I-M: Método Regula Falsi modificado
N-Z: Método da Secante

Questão 2 *Calcule a volatilidade implícita usando as funções blsprice e fzero do MATLAB.*

Questão 3 *Programe o Método de Newton e use-o para calcular a volatilidade implícita.*

Questão 4 *Compare o resultado da questão anterior com o obtido pela função blsimpv do MATLAB.*

OBS.: Em todas as questões acima analise o tempo gasto usando por exemplo a função tic/toc do MATLAB.