Derivativos

Setembro - Novembro 2005

Guia de Estudos

1. Revisar mercados incompletos/medidas martingais equivalentes/numerario
2. Revisar Lema de Ito. Transformacao de Girsanov.
3. Lista 1
4. Lista 2
5. Lista 3
6. Lista 4
7. Mostrar que a propriedade de uma estrategia de portfolio ser auto-financiada não depende do numerário. (c.f. Lema 1.6 p 10 notas de Grasselli)
8. Definições (e relações) entre taxa spot e taxa forward instantanea.
9. Como transformar equações de Ricatti em equações lineares de segunda ordem?
10. Demonstre a Proposição 2.1 da página 15 das notas de aula. (de novo!)

Lista # 5

Entregar até às 19:00 do dia 25/10/2005.

1. Verifique as formulas para o preço das bonds no modelo de Vasicek, pagina 17, das notas de aula.
2. Verifique a formula para a taxa spot r_t da dinamica em $\mathbb{Q}$ no modelo de Vasicek exponenciado.
3. Demonstre a Prop. 3.1 da pagina 21 (modelo de Ho-Lee).