Derivativos

Setembro - Novembro 2005

Lista # 6
Entregar até às 19:00 do dia 10/11/2005.

1. Verifique as formulas para o preço das bonds no modelo de Vasicek extendido (Hull-White), pagina 22, das notas de aula.

2. Verifique as formulas (62) e (63) das notas de aula para o modelo CIR++.

3. Verifique (corrigindo-a se necessário for) a fórmula (65) que relaciona o coeficiente $\alpha(t,T)$ com o preço de mercado do risco λ_t no caso do modelo HJM.