Métodos Matemáticos em Finanças

Setembro - Novembro 2006

Lista # 4

Entregar até às 19:00 do dia 27/10/2006.

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).