Derivativos

Setembro - Novembro 2006

GUIA DE ESTUDOS PARA A QUIZ

1. Listas 3 e 4.
2. Defina as taxas continuamente e simplesmente compostas, e a taxa spot.
3. Explique os dois teoremas fundamentais de precificação por arbitragem.
4. Exemplifique a utilização da técnica de mudança de numerário para apreçamento de derivativos.
5. Defina modelos afins.
6. Descreva os modelos de Vasicek, Dothan, Vasicek exponencial, CIR, Ho-Lee, Hull-White, CIR++.
7. Exemplos de derivativos sobre taxas de juros: Descreva um acordo de taxa futura (forward rate agreement), um swap de taxa de juros, caplet, floorlet.
8. Modelos de risco de crédito: Descreva o modelo para eventos de default, explicando a probabilidade avançada de default (forward default probability), a taxa de sinistralidade (hazard rate), a taxa avançada de default, a intensidade de default.
9. Descreva o modelo de Merton.
10. Deduza a identidade fundamental de contabilidade como consequencia da paridade *call-put*
11. Descreva de modo geral o que são modelos de primeira passagem para risco de crédito.
12. Descreva modelos de excursão para risco de crédito.