

Matemática Financeira

Ano Lectivo 2005/06

Trabalho 3

Data de recepção: **21/03/2006**; Data de entrega: **03/04/2006** (na aula teórica)

- Exercícios 1 e 3 da Aula 7.
- Exercício 2 da Aula 8.
- Exercícios 1, 4 e 6 da Aula 9.
- Trace um sorriso da volatilidade recorrendo à `m-file` da Aula 10 (`vol_imp`) e a preços de mercado de opções europeias sobre o índice accionista S&P (www.cboe.com).