

# Matemática Financeira

Ano Lectivo 2005/06

## Trabalho 5

Data de recepção: **17/05/2006**; Data de entrega: **26/05/2006**

---

- Simule, em MATLAB, as equações diferenciais estocásticas dos modelos de taxas de juro de Vasicek e de Cox, Ingersoll e Ross. Tome  $a = b = 0.1$ ,  $\sigma = 0.02$ ,  $t_0 = 0$ ,  $T = 100$ ,  $\Delta t = 0.1$  e  $r_0 = 0.05$ . Apresente os resultados sobrepondo 10 corridas do simulador na mesma figura. Comente os resultados obtidos.
- Resolva um dos Exercícios, 3 ou 4, da Aula 17.