

# Matemática Financeira

Ano Lectivo 2006/07

## Trabalho 5

Data de recepção: **27/11/2006**; Data de entrega: **13/12/2006**

---

- Exercício 3 da Aula 16.
- Simule, em MATLAB, as equações diferenciais estocásticas dos modelos de taxas de juro de Vasicek e de Cox, Ingersoll e Ross. Justifique as fórmulas utilizadas na simulação.

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.

- Exercício 2 da Aula 17.
- Exercício 1 da Aula 18.