

SEMINÁRIO DE PROBABILIDADE

O Modelo de Black-Scholes e Precificação de Opções.

Alex Barros Azevedo Bomfim

Departamento de Matemática Universidade de Brasília

12/08/2022, Brasília

Horário: 2:15 pm

Local :us02web.zoom.us/j/87064304629?pwd=Q1A4dW9DUk5WT1MyN3diQThTMnNCUT09

Abstract. Neste seminário, apresentamos o modelo de Black-Scholes para precificar uma opção de compra europeia. A fórmula de Black-Scholes será obtida a partir de uma equação diferencial parcial particular que possui solução explícita.

References

- [Kuo] Kuo, H. Introduction to Stochastic Integration. Springer, 2006.
- [Mik] Mikosch, T. Elementary Stochastic Calculus With Finance in View. World Scientific Publishing Company, 1999.
- [Osk] Øksendal, B. Stochastic Differential Equations. 5th edition, Springer, 2000