

Mestrado em Matemática Financeira 2009/2010

Métodos Numéricos em Finanças

Tópicos do programa

- ✚ 1 – Equações Diferenciais
- ✚ 2 – Conceitos Básicos
- ✚ 3 – Opções Europeias. Solução exacta.
- ✚ 4 -- Soluções Numéricas. Método explícito
- ✚ 5 – Diferenças Finitas: método implícito
- ✚ 6 -- Opções Americanas
- ✚ 7 – Modelo Binomial
- ✚ 8 – Introdução ao Método de Monte Carlo
- ✚ 9 -- Séries Pseudo-aleatórias
- ✚ 10 – Vectores Aleatórios Normais

Bibliografia

Principal

- Glasserman, Paul Monte Carlo, Methods in Financial Engineering- Stochastic Modelling and Applied Probability , Springer, 2003
- Tavella, Domingo & Randall, Kurt, Pricing Financial Instruments: The Finite Difference Method , Wiley, 2000.
- Willmot, P., Dewynne, J. & Howison, S. "Option Pricing – Mathematical models and computation", Oxford Financial Press, 1993, sixth edition (last reprint 2006)

Secundária

- Hull, J. "Options, Futures and Other Derivatives", Prentice Hall, 5th edition 2003.

E ainda

- Grossinho, M. R. "Métodos Numéricos em Finanças" Notas sobre a disciplina