

Reposição de Finanças

Sérgio Bezerra
sergio@ci.ufpb.br

Maio 2024

Cada um de vocês irá construir o modelo binomial do ativo abaixo, associado a cada um de vocês. Eu quero que cada um faça o cálculo da precificação de uma opção de call com três passos, numa primeira etapa você faz o código na mão e numa segunda etapa constroi no python a árvore binomial referente. Defina cada um de vocês os valores dos parâmetros do seu modelo (defina valores plausíveis).

Dayane - Shell pic

Thales - Itaú Unibanco

Gabriel - Banco do Brasil SA

Paulo - Petrobrás

Jonas - Vale SA.

Se mais alguém fizer a prova, este deve escolher um ativo diferente dos acima. A resolução deve ser feita num notebook python. Cada um de vocês me envia o link de acesso ao notebook e em anexo o notebook.

A entrega deve ser feita até as 12hs do dia 10 de maio de 2024.