
A equação de Black-Scholes com ação
impulsiva

Everaldo de Mello Bonotto

SERVIÇO DE PÓS-GRADUAÇÃO DO ICMC-USP

Data de Depósito: 27 de Maio de 2008

Assinatura: _____

A equação de Black-Scholes com ação impulsiva

Everaldo de Mello Bonotto

Orientadora: *Profa. Dra. Márcia Cristina Anderson Braz Federson*

Tese apresentada ao Instituto de Ciências Matemáticas e de Computação - ICMC-USP, como parte dos requisitos para obtenção do título de Doutor em Ciências - Matemática.

USP - São Carlos

Maio/2008

*Aos meus pais,
Heleno e
Maria.*

Agradecimentos

Agradeço a Deus por sempre estar presente em minha vida.

Aos meus pais, que me deram a oportunidade de estudo e graças a eles pude conquistar mais uma etapa em minha vida. À minhas irmãs que sempre estiveram incentivando-me e torcendo por mim.

Às professoras Eti, Lúcia Spegiorin, Ilza e Adalcira, que sempre acreditaram em mim e sempre me ajudaram para meu egresso da universidade.

Aos meus amigos e professores do curso de graduação em Licenciatura Plena em Matemática pela UNESP de Presidente Prudente. Não posso deixar de citar os professores José Roberto, Biroca, Suetônio, Marcelo Messias e Maria Raquel que sempre me ajudaram e me apoiaram a continuar os estudos, e, os alunos Angela, Rodrigo e Taciana que são meus verdadeiros amigos que fiz na graduação. Em especial à Profa. Dra. Monica Fürkotter, pela sua orientação, amizade e incentivos.

Aos professores do ICMC pelo ensino de qualidade e aos funcionários do ICMC pelo excelente trabalho que é desenvolvido neste instituto.

Aos meus amigos de minha turma de doutorado Aldicio, Andréa, Juliano, Nivaldo, Sandro e Thiago, pelo companherismo e pelos estudos em grupo. Em especial aos amigos que sempre

estiveram presentes em minha caminhada nos momentos de diversão: Ana Carla, Daniela, Esdras, Fernando, Graziela, José Paulo, Michele, Nivalda, Sadao, Ricardo, Sandra, Sandro e Tatiane.

Nivaldo e Suelen, obrigado pela amizade sincera que temos. Passamos por ótimos momentos durante esta temporada em São Carlos.

A todos meus amigos de Derry na Irlanda do Norte. Este último ano de meu doutorado foi muito gratificante. Tive a oportunidade de conhecer uma nova cultura e valiosas amizades como os amigos Aaron, Amy Rawle, Brandon Kastner, Chichi, Daiana Webster, Emmet Colton, Erin Smith, Francis Ward, Kai-Yu Tseng, Karla Muñoz, Kevin e Laura Fowler, meus amigos da igreja Cornerstone: Abdul, Claire Collins, Claire, Jasper, Jessica, Kirstin, Mappi, Mawusi, Nadege, Stephen Brown e Wendy. Não posso esquecer de citar Vicent, Pauline, Hilda, Cris, Billy e Anna pela amizade e hospitalidade.

Estar longe da família e dos amigos é uma situação difícil de se lidar. No entanto, agradeço a família Graham: Bernie, David, Michael e Richard que me adotaram como um integrante da família e me proporcionaram uma excelente estadia na Irlanda do Norte.

Ao meu supervisor, o prof Dr. Patrick Muldowney da University of Ulster, Irlanda do Norte. Pat Muldowney e sua esposa Marie foram grandes amigos e agradeço a eles por tudo o que eles fizeram por mim.

Sou extremamente grato à minha orientadora, a professora Dra. Márcia Federson, que foi de fundamental importância para o desenvolvimento deste trabalho. Amizade, paciência e disposição são poucas das qualidades que ela possui. Com certeza não teria trabalhado em diferentes áreas simultaneamente com um outro orientador! Obrigado por tudo e por ter aceitado a me orientar.

Ao CNPq e a CAPES pelo apoio financeiro para realização deste trabalho.

Agradeço a todos os meus amigos que contribuíram de alguma forma para a realização deste trabalho.

Resumo

Impulsos são perturbações abruptas que ocorrem em curto espaço de tempo e podem ser consideradas instantâneas. E os mercados financeiros estão sujeitos a choques bruscos como mudanças de governos, quebra de empresas, entre outros. Assim, é natural considerarmos a ação de tais eventos na precificação de ativos financeiros. Nosso objetivo neste trabalho é obtermos uma formulação para a equação diferencial parcial de Black-Scholes com ação impulsiva de modo que os impulsos representem estes choques. Utilizaremos a teoria de integração não-absoluta em espaço de funções para obtenção desta formulação.

Gracias por visitar este Libro Electrónico

Puedes leer la versión completa de este libro electrónico en diferentes formatos:

- HTML(Gratis / Disponible a todos los usuarios)
- PDF / TXT(Disponible a miembros V.I.P. Los miembros con una membresía básica pueden acceder hasta 5 libros electrónicos en formato PDF/TXT durante el mes.)
- Epub y Mobipocket (Exclusivos para miembros V.I.P.)

Para descargar este libro completo, tan solo seleccione el formato deseado, abajo:

