

ALMEIDA, L. A. **Análise do modelo Hull-White para o Mercado Brasileiro de Derivativos de Taxas de Juros**. São Paulo, 2002. 87p. Dissertação (Mestrado) - Universidade de São Paulo – Faculdade de Economia, Administração e Contabilidade e ao Instituto de Matemática e Estatística da Universidade de São Paulo. Prêmio BM&F Derivativos 2002.

_____.; YOSHINO, J.; SCHIRMER, P. P. S. **Derivativos de Renda Fixa no Brasil: Modelo Hull-White**. Pesquisa e Planejamento Econômico, v. 33, n. 2, p. 299 - 333, ago. 2003.

BARBACHAN, J. S. F.; ORNELAS, J. R. H. (2003a). **Apreçamento de opções de IDI usando o modelo CIR**. Estudos Econômicos, v. 33, n. 2, p. 287–323, abr./jun. 2003a.

_____. **Apreçamento de opções de IDI usando distribuições hiperbólicas generalizadas**. Economia Aplicada, v. 7, n. 4, p. 768 - 794, 2003b.

BARBEDO, C. H.; VICENTE, J. V.; LION, O. B. Pricing Asian Interest Rate Options with a Three-Factor HJM Model. **Revista Brasileira de Finanças**, v. 8, n. 1, p. 9 - 23, 2010.

BARCINSKI, A. **Hedging Strategies Using a Multifactor Model for the Brazilian Interest Rate**. Working Paper, 2000.

BLACK, F. The Pricing of Commodity Contracts. **Journal of Financial Economics**, v. 3, p. 167–179, 1976.

_____.; DERMAN, E.; TOY, W. A One Factor Model of Interest Rates and Its Application to Treasury Bond Options. **Financial Analysts Journal**. v. 46, p. 33-39, 1990.

_____.; SCHOLES, M. The Pricing of Options and Corporate Liabilities. **Journal of Political Economy**. v. 81, p. 637-659, 1973.

BRENNAN, M. J.; SCHWARTZ, E. S. Analyzing Convertible Bonds. **Journal of Finance and Quantitative Analysis**, v. 15, p. 907-929, 1980.

BUHLER, W.; UHRIG-HOMBURG, M.; WALTER, U.; WEBER, T. An Empirical Comparison of Forward-Rate and Spot-Rate Models for Valuing Interest Rate Options. **Journal of Finance**, v. 54, n. 1, p. 269-305, 1999.

COX, J.; INGERSOLL, J.; ROSS, S. **A Theory of the Term Structure of Interest Rates**. Econometrica. v. 53, p. 385-407, 1985.

GLUCKSTERN, M. C.; FRANCISCO, G.; EID JR., W. Aplicação do modelo Hull-White a precificação de opções sobre IDI. **Anais do Segundo Encontro Brasileiro de Finanças**, 2002.

GROSSO, L. M. P. **Apreçamento de Opções sobre Futuro de Depósitos Inter-financeiros de um Dia**. Rio de Janeiro, 2006. 84 p. Dissertação (Mestrado) - Programa de Pós Graduação em Engenharia Industrial da PUC-Rio.

HEATH, D.; JARROW, R.; MORTON, A. **Bond Pricing and Term Structure of Interest Rates: A New Methodology for Contingent Claims Valuation**. *Econometrica*, v. 60, n. 1, p. 77-105, 1992.

HINZ, J.; GRAFENSTEIN, L.; VERSCHUERE, M.; WILHELM, M. **Pricing Electricity Risk by Interest Rate Methods**. Working paper, 2005.

HO, T. S. Y.; LEE, S. B. Term structure movements and pricing interest rate contingent claims. **Journal of Finance**. v. 41, p. 1011-1029, 1986.

HULL, J. C. **Options Futures and Other Derivatives**. 7. ed. Editora Prentice Hall, 2005. 822p.

_____.; WHITE, A. One-factor interest-rate models and the valuation of interest-rate derivative securities. **Journal of Financial and Quantitative Analysis**, v. 28, p. 235 - 253, 1993.

_____.; _____. **Pricing Interest Rate Derivative Securities**. *Review of Financial Studies*, v. 3, n. 4, p. 573-592, 1990.

JUNIOR, A. F. et al. Application of Hull-White Model to Brazilian IDI Options. **Anais do Encontro da Sociedade Brasileira de Finanças**, 2003.

KNEZ, P.; LITTERMAN, R.; SCHEINKMAN, J. Exploration Into Factors Explaining Money Market Returns. **Journal of Finance**, v. 49, n. 5, p. 54 - 61, 1994.

LITTERMAN, R.; SCHEINKMAN, J. Common Factors Affecting Bond Returns. **Journal of Fixed Income**, p. 54 - 61, 1991.

LONGSTAFF, F. A.; SCHWARTZ, E. S. Interest Rate Volatility and the Term Structure: A Two Factor General Equilibrium Model, **Journal of Finance**, v. 47-4, p. 1259-1282, 1992.

NETO, C. A. V.; PEREIRA, P. L. V. Closed Form Formula for the Price of the Options on the 1 Day Brazilian Interfinancial Deposits Index - IDI. **Anais do XXII Congresso Brasileiro de Econometria**, v. II, 2000.

SENGER, M. C. M.; ROSENFELD, R. **Apreçamento e Hedge de Opções sobre Taxa de Juro no Brasil: Uma Comparação entre os Modelos de Black, Vasicek e Black-Derman-Toy**. Working Paper, 2008.

SILVA, M. E. **Precificação de Opções sobre o Futuro de DI com o Modelo de Black, Derman e Toy**. *Resenha BM&F*, Jan-Fev 115, 1997.

TAMAGUSHIKU, C. **Heath, Jarrow and Morton Interest Rate Modelling Using Principal Component Analysis**. Working Paper, 2006.

TROLLE, A. B.; SCHWARTZ, E. S. **Unspanned Stochastic Volatility and the Pricing of Commodity Derivatives**. Working Paper, 2008.

VASICEK, O. An Equilibrium Characterization of the Term Structure. **Journal of Financial Economics**. v. 5, p. 177-188, 1977.