



VALUACIÓN DE OPCIONES EXÓTICAS

Objetivo General

Dotar al alumno de los conocimientos necesarios para valorar derivados distintos a los "vainilla".

Contenido

1. Modelo de Schroeder - Cox - Ross (elasticidad constante de varianza)
2. Modelo de Merton (opciones con procesos de difusión con saltos)
3. Opciones potencia
4. Valuación de opciones con procesos de Levy
5. Opciones Asiáticas
6. Tiempos de paro y máximos y mínimos del Browniano
7. Modelo e Goldman - Sosin - Gatto (opciones lookback)
8. Modelo de Merton para opciones con barreras

Bibliografía

- Venegas, F. (2008). Riesgos financieros y económicos, productos derivados y decisiones económicas bajo incertidumbre. 2ª Edición. Cengage.
- Hull, J. (2005). Options, Futures and Other, Derivatives. 6th Edition.
- Neftci, s. (2000). An introduction to the Mathematics of Financial Derivatives, Second Edition. Academic Press.