

A5 - Finanzas II: Derivados

BLOQUE - 1

Fórmulas analíticas y árboles

1.1. Valoración mediante fórmulas analíticas

a. Opciones vanilla europeas:

- Black-Scholes

b. Opciones vanilla americanas:

- Barone-Adesi-Whaley
- Bjerksund-Stensland

c. Opciones exóticas

1.2. Valoración mediante árboles

a. Árboles binomiales

- Cox-Ross-Rubinstein
- Jarrow-Rudd

b. Árboles trinomiales

BLOQUE - 2

Metodología de Monte Carlo y Opciones Exóticas

2.1. Fundamentos del método Monte Carlo

a. Nociones básicas

b. Integración por Monte Carlo

c. Generación de números y caminos aleatorios

d. Monte Carlo multidimensional

e. Control del error y reducción de varianza

2.2. Valoración de derivados exóticos

a. Valoración riesgo neutro y derivados exóticos

b. Opciones Forward start y Digitales

c. Opciones Barreras y Asiáticas

d. Opciones sobre varios subyacentes

e. Implementación práctica de la valoración

Módulo M1- Programación VBA con Excel aplicada a Seguros y Finanzas

Asignatura A5 - Finanzas II: Derivados.

Profesor: Daniel Arrieta.

MÁSTER PROPIO UCM ONLINE EN PROGRAMACIÓN SAS Y VBA CON EXCEL APLICADA A SEGUROS Y FINANZAS

Universidad Complutense de Madrid.