

Taller

Financial Derivatives

Universidad de La Salle

2020

Descargue los precios de cierre de cuatro acciones de diferentes sectores del mercado de valores de Estados Unidos y realice el siguiente ejercicio con cada una

1. Pronóstique los precios usando el modelo geométrico Browniano MGB a tres meses, use 1000 simulaciones.
2. Obtenga el precio de una opción Call y Put con el precio de ejercicio que se indica en Yahoo para un vencimiento de tres meses usando el modelo geométrico Browniano MGB. Use la tasa de interés de los Tbill money a tres meses.
3. Después de realizar los pronósticos de las acciones y de obtener la prima de cada opción (de cada acción), Escoja dos opciones (Explique las razones usando los cálculos anteriores)
4. Compare los resultados con el taller del modelo binomial. ¿Qué puede concluir de esta comparación?
5. Obtenga la paridad put call en las opciones con precios strike a un mes