



UNIVERSIDAD ADOLFO IBÁÑEZ

DERIVADOS AVANZADOS

CALIBRATING AN OPTION PRICING MODEL WITH MARKET DATA

Alumnos:

Felipe Galdames Vial

Felipe Duran Aranda

Profesor:

Prof. Jacques Burrus

Ayudantes:

Alejandro Olguin

Guillermo Sepulveda

Trabajo que busca presentar los análisis, resultados y conclusiones obtenidos para cada uno de los pasos del proyecto Calibrating an Option Pricing Model With Market Data, donde se aplican diversos modelos de valorización teóricos con información financiera real de los mercados

Magíster Ingeniería Financiera
Facultad de Ingeniería y Ciencias

23 de Octubre, 2020

CALIBRATING AN OPTION PRICING MODEL WITH MARKET DATA

by

Felipe Galdames Vial

Felipe Duran Aranda

UAI MIF

Tutorial que busca verificar el teorema de Feynman-Kac donde se plantea que el precio de un derivado financiero puede ser calculado de forma algebraica mediante las diferencias finitas.

Universidad Adolfo Ibañez

Septiembre, 2020

COPYRIGHT ©2020, BY FELIPE GALDAMES VIAL
FELIPE DURAN ARANDA
ALL RIGHTS RESERVED.