



UNIVERSIDAD ADOLFO IBÁÑEZ

DERIVADOS AVANZADOS

CALIBRATING AN OPTION PRICING MODEL WITH MARKET DATA

Autores:

Felipe Durán Aranda

Felipe Galdames Vial

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

18 de Agosto, 2020

CALIBRATING AN OPTION PRICING MODEL WITH MARKET DATA

by

Felipe Durán Aranda

Felipe Galdames Vial

UAI MIF

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.

Universidad Adolfo Ibañez

Agosto, 2020