

1. Calculen en TensorFlow Delta, Theta, Rho, Vega y Gamma para opciones europeas usando la fórmula de Black-Scholes
2. Repitan el ejercicio anterior pero ahora calculando el precio de las opciones por Monte Carlo y las correspondientes “path-wise Greeks”.
3. Repitan para alguna opción exótica como asiáticas, barreras, lookback, etc.
4. Usen el método de Longstaff-Schwartz para calcular el valor de una opción americana. Si ahora, por ejemplo, tenemos una opción “basket” americana de +10 componentes, compare resolver la regresión tradicional para los valores de continuación con todos los polinomios de 2do orden con la que resuelve la regresión usando algún método de descenso por gradientes. ¿Qué regresión resulta más rápida?