



CONTENIDO ANALÍTICO

[1] IDENTIFICACIÓN

B	MENCIÓN: ECONOMÍA FINANCIERA	
ASIGNATURA:	TÓPICOS EN FINANZAS	SIGLA: TF-613
ÁREA CURRICULAR:	COMPLEMENTARIAS Y METODOLÓGICAS	CICLO: PROFESIONAL
MODALIDAD:	SEMESTRAL	NIVEL : OCTAVO SEMESTRE
PRE-REQUISITO:	FC-612	

[2] OBJETIVO

Dotar de instrumentos y técnicas que permitan desarrollar las finanzas cuantitativas mediante la modelación y simulación

[3] CONTENIDO

- 1. Modelos en tiempo discreto**
 - 1.1. Modelo Cox-Ross-Rubinstein.
 - 1.2. Probabilidad libre de riesgo
 - 1.3. Oportunidades de Arbitraje
 - 1.4. Replicas y arbitraje

- 2. Modelo en tiempo continuo**
 - 2.1. El modelo de Black y Scholes
 - 2.2. Lema de Ito
 - 2.3. Probabilidad libre de riesgo y Teorema de Girsanov
 - 2.4. Construcción del portafolio

- 3. Aplicación**
 - 3.1. El modelo de Black y Scholes
 - 3.2. Identificación de parámetros
 - 3.3. Paridad Put-Call
 - 3.4. Opciones con dividendos
 - 3.5. Opciones sobre divisas
 - 3.6. Opciones americanas de compra
 - 3.7. Opciones americanas de venta
 - 3.8. Opciones americanas perpetuas
 - 3.9. Otros instrumentos

[4] BIBLIOGRAFÍA

- Modigliani, F., "Mercados e instituciones financieras"
- Ross, S., "Finanzas corporativas"
- Englis, K., "Introducción a la ciencia financiera"