

Métodos numéricos en Finanzas

Jose Ruiz Moreno

23 de diciembre de 2018

Resumen

Intentar modelizar y estimar los movimientos en el precio de los activos financiero ha sido, desde hace mucho tiempo, una constante para los expertos de la materia, pero dada aleatoriedad de estos procesos, siempre ha habido dificultades.

En la presentacin hecha en Beamer se proponen diferentes métodos numricos que se han utilizado para determinar el ruido blando o paseo aleatorio que son los mercados financieros.

Tanto el Movimiento Browiano como el modelo Black-Scholes supusieron un gran paso adelante en esta determinación de la realidad, siendo este ultimo, sus creadores ganaron el premio Nobel de Economía en 1.997, el cual es ampliamente utilizado para la valoración de opciones sobre activos financieros.