

PROGRAMA DE CURSO

Código	Nombre		
MA6923	Seminario Avanzado de Matemáticas I		
Nombre en Inglés			
SCT	Horas de Cátedra	Horas Docencia Auxiliar	Horas de Trabajo Personal
6	5		5
Requisitos		Carácter del Curso	
		Electivo de Carrera, Magister y Doctorado	
Resultados de Aprendizaje			
<p>La metodología de evaluación consistirá en lecturas y exposiciones de parte de estos artículos y un informe final.</p>			

Metodología Docente	Evaluación General
<ul style="list-style-type: none"> Clase expositiva 	<ul style="list-style-type: none"> Trabajo personal

Unidades Temáticas

Número	Nombre de la Unidad	Duración en Semanas
	<p><u>Métodos Modernos para Valuar Derivados Financieros</u></p> <p>Este curso pretende dar respuesta a las siguientes preguntas: ¿Que es un derivado financiero? ¿Para que existen? ¿Cómo los usamos? Y ¿cómo los valuamos? Con este fin, introduciremos los teoremas fundamentales de valuación, discutir la diferencia ente los mercados completos y los mercados incompletos, repasaremos</p>	

	<p>modelos importantes como el modelo binomial, el famoso model Black y Scholes, y los modelos de volatilidad estocástica y presentaremos estrategias dinámicas y estáticas para cobertura. Se espera que los estudiantes han tenido un curso básico en probabilidad y procesos estocásticos.</p>	
--	---	--

Bibliografía General	
<p>La bibliografía se entregará durante el curso en el semestre.</p>	

Vigencia desde:	Otoño 2019
Elaborado por:	Matt Lorig
Revisado por:	