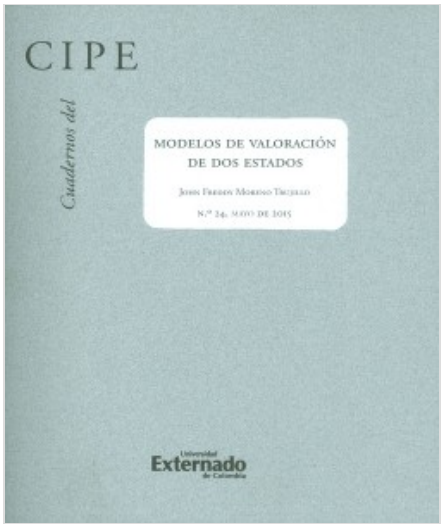
# Cuadernos del CIPE No.24.

## Modelos de valoración de dos estados

**Autor**
*Jhon Freddy Moreno Trujillo*




Escanea para ver en línea

### Sinopsis

El presente documento es una introducción formal a los modelos de valoración de dos estados. es decir, modelos de valoración de activos contingentes en los cuales se asume que el subyacente puede presentar solamente dos posibles precios distintos entre un periodo y el siguiente. Estos modelos también son conocidos como modelos binomiales. y su importancia está en la sencillez de las matemáticas implícitas en su desarrollo. y el amplio espectro de problemas que pueden ser resueltos con este. que aunque sencillo. no deja de ser elegante. y permite comprender de forma clara importantes conceplos de la valoración financiera. El documento está dividido en cuatro capítulos. El primero presenta una introducción al elemento base de los modelos de valoración financiera en general. el concepto de no arbitraje. El segundo capítulo presenta una descripción completa del modelo binomial de valoración en uno y varios periodos. El capítulo tres desarrolla aplicaciones del modelo de valoración al caso de algunos derivados particulares, pasando por los más básicos como son las opciones plain vanilla, y llegando a considerar derivados de tipo de cambio y tasa de interés. En el capítulo cuatro se expone la aproximación al cálculo de sensibilidades (griegas) en este tipo de modelos.

### Impreso

**Año de publicación:** 2015

**Presentación:** Tapa blanda o Bolsillo

**Tamaño:** 19.5 x 23 cm

**Número absoluto de páginas:** 32 Páginas

**ISBN13:** 1794771524

**$8.000 COP**

2026 © Sistema Integrado de Metadata Estandarizada desarrollado por Hipertexto - Netizen

JM

## Sobre el autor

Jhon Freddy Moreno Trujillo

Profesor en pregrado de los cursos: Cobertura de riesgo con derivados; Finanzas Computacionales; Herramientas de Cálculo y Estadística para Machine Learning.


**E-Book**

**Año de publicación:** 2015

**Presentación:** PDF (Digital: descarga)

**ISBN13:** 17947715


**$5.000 COP**

2026 © Sistema Integrado de Metadata Estandarizada desarrollado por Hipertexto - Netizen

Profesor en Posgrado de los cursos: Cálculo Estocástico para finanzas; Control óptimo estocástico; Modelos de tasas de interés y aplicaciones; Optimización estocástica; Valoración de activo y derivados.Mis temas actuales de investigación son: modelos no lineales de valoración de activos contingentes; Ecuaciones diferenciales parciales no lineales y extensiones del teorema de representación estocástica de Feynman-Kac; Control óptimo estocástico.MatemáticoUniversidad Nacional de ColombiaBogotá, ColombiaMagister en Matemática AplicadaUniversidad Nacional de ColombiaBogotá, ColombiaCandidato a Doctor en Ciencias EconómicasUniversidad Nacional de ColombiaBogotá, Colombia

2026 © Sistema Integrado de Metadata Estandarizada desarrollado por Hipertexto - Netizen