



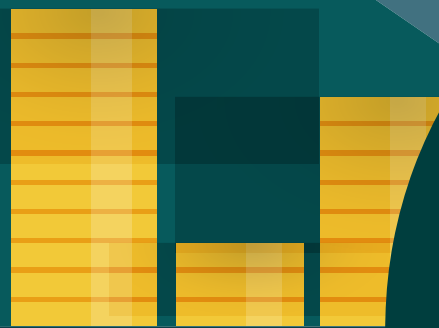
INTRODUCCIÓN A MODELOS MATEMÁTICOS EN GESTIÓN FINANCIERA

DESCRIPCIÓN:

Este curso es una introducción a diferentes áreas de la matemática que prestan servicio a la solución de problemas de modelación y análisis en la gestión y el diseño de productos y mercados financieros. El curso contempla los fundamentos teóricos y la aplicación práctica de los conceptos matemáticos imprescindibles para las tareas mencionadas.

El curso comprende elementos de programación cuadrática y análisis convexo aplicados a la teoría de portafolios de mínima varianza, análisis de árboles binomiales para la valoración de derivados, ecuaciones diferenciales parciales parabólicas para la valoración de derivados y el análisis de series temporales para estimación de riesgos.

El curso contempla la realización de experiencias prácticas en laboratorios de cómputo especializados para la mejor comprensión de los conceptos y las técnicas presentadas durante el curso.



MATE-2714

PROFESOR:

René Meziat

Departamento de Matemáticas
Universidad de los Andes

PROGRAMA:

- PORTAFOLIOS ÓPTIMOS Y TEORÍA DE MERCADO DE CAPITALES
- CÁLCULO ESTOCÁSTICO Y VALORACIÓN DE DERIVADOS
- VALORACIÓN DE ACTIVOS MEDIANTE EL MODELO BINOMIAL
- SERIES TEMPORALES Y VOLATILIDAD

laboratoriomatematicas.uniandes.edu.co/financieras