

Trabajos Fin de Grado
Curso 2017-18
Alessandro Ferriero

1. "La integral estocástica de Itô"

El objetivo del trabajo es introducir la integral de Itô y su aplicación en finanzas para modelizar la variación de precio de un activo del mercado financiero.

Referencias:

"Stochastic Calculus for Finance" I and II, S. Shreve.

2. "El valor de una put option americana y las ecuaciones de Hamilton-Jacobi-Bellman"

El objetivo del trabajo es introducir las ecuaciones de Hamilton-Jacobi-Bellman para el control óptimo estocástico, y aplicar estas ecuaciones para calcular el precio de una put option americana.

Referencias:

1- "Optimal Stopping and Free-Boundary Problems", G. Peskir, A. Shiryaev.

2- "Stochastic Calculus for Finance" I and II, S. Shreve.