



Universidad Simón Bolívar

DIVISION	FISICA Y MATEMATICAS		
DEPARTAMENTO:	COMPUTO CIENTIFICO Y ESTADISTICA		
ASIGNATURA:	CO5517 MATEMATICAS FINANCIERAS III		
HORAS / SEMANA:	TEORIA 4	LABORATORIO 0	PRACTICA 1
VIGENCIA:	SEPTIEMBRE 2001		
REQUISITOS:	Curso introductorio sobre Procesos Aleatorios en tiempo discreto.		

Programa

- I. Introducción a los derivados financieros.
- II. Modelos dinámicos simples de valores.
- III. Introducción a la teoría de opciones y su valuación.

OBJETIVOS:

Introducción matemática a la teoría de derivados y los métodos para su valuación

Bibliografía

- Luenberger, D. "Investment Science" Oxford, 1998 (primeros cuatro capítulos)
- Bodie, Z y Merton, R. "Finanzas", Prentice-Hall, 1999 (capítulos del 4 al 9 de la segunda y tercera parte).

REFERENCIA SUPLEMENTARIA:

FABOZZI, F.; MODIGLIANI, F. Y FERRI, M. "Mercados e Instituciones Financieras". Pearson. 1996.