

Propuesta de Trabajos Fin de Grado, curso académico 2018-19

PROFESOR: Alessandro Ferriero

1.- TÍTULO: El valor de una put-option americana y las ecuaciones de Hamilton-Jacobi-Bellman

Resumen/contenido: 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.

Bibliografía/referencias:

- 1- "Optimal Stopping and Free-Boundary Problems", G. Peskir, A. Shiryaev.
- 2- "Stochastic Calculus for Finance" I and II, S. Shreve.