

Tema 14: Métodos de Diferencias Finitas

Los Métodos de Diferencias Finitas son una herramienta fundamental para la valuación de derivados financieros. El objetivo de este trabajo será elaborar un reporte/artículo en el cual se investigue la temática y se implemente alguna variante de los métodos.

Además de la bibliografía básica, se pueden utilizar como referencias principales, el capítulo 2 de Andersen y Piterbarg[1], así como el libro de Duffy[2].

Referencias

- [1] Andersen, L.B.G and Piterbarg, V.V.. *Interest Rate Modeling* Atlantic Financial Press. 2006.
- [2] Duffy, D. *Finite Difference Methods in Financial Engeneering*. Wiley Finance. 2006