

Índice general

Prefacio	III
Índice general	VII
15. Modelos de tipos de interés instantáneo	1
15.1. Estudio general	1
15.1.1. Precio del bono cupón-cero	4
15.1.2. Precio de opción independiente del camino sobre un bono cupón-cero	5
15.2. Modelos particulares	6
15.2.1. Modelos afines	6
15.2.2. Modelos no afines	10
16. Modelo de Heath-Jarrow-Morton	13
16.1. Estudio general	13
16.1.1. Modelo HJM en mercados financieros completos y sin arbitrajes	21
16.1.2. Opciones europeas sobre bonos cupón-cero en el mo- delo HJM	36
16.2. Casos particulares del modelo HJM	39
16.2.1. Modelo HJM de Cheyette (HJM(Ch))	39
16.2.2. Modelo Ho-Lee como modelo HJM(Ch)	40
16.2.3. Modelo Hull-White como modelo HJM(Ch)	43
16.2.4. Modelo HJM de Ritchken-Sanakarasubramanian (HJM(RS))	46
16.2.5. Modelos HJM Gaussianos	49

16.2.6. Modelo HJM de Mercurio-Moraleda (HJM(MM)) . . .	57
16.3. Otros métodos de estudio del modelo HJM	59
16.3.1. Modelos HJM y la integral de caminos de Feynman . .	59
16.3.2. Precio del bono cupón-cero	61
16.3.3. Precio de opción no dependiente del camino sobre bono cupón-cero	68
17. Curvas de tipos de interés <i>forward</i>	71
17.1. Tipos de interés <i>forward</i>	71
17.2. Precio de una opción europea sobre un bono cupón-cero . .	73
17.3. Modelo de Heath-Jarrow-Morton generalizado	78
A. Complemento de modelos afines	81
B. Procesos estocásticos generalizados	83
B.1. Proceso estocástico ruido blanco	83
B.2. Procesos estocásticos de Gel'fand-Vilenkin	85
Bibliografía	93
Índice alfabético	103
Símbolos	107
