



Metamorfosis del Modelo Binomial

Karla Tapia Solares¹, Francisco Solano Tajonar Sanabria¹, Fernando Velasco Luna¹ y Hugo Adán Cruz Suárez¹

¹ Benemérita Universidad Autónoma de Puebla. karla.tapia.solares@gmail.com

El presente trabajo tiene como objetivo principal, obtener el valor de una opción de compra Europea. Para lograr el propósito de la misma se revisó la teoría en la literatura de matemáticas financieras, lo cual nos permitió llevar a cabo la valuación de opciones. Como resultado se obtuvo que el modelo Binomial fue el primer modelo para valorar opciones, en el cual se considera que el precio del activo sigue un modelo Binomial en intervalos de tiempo, los cuales se toman como periodos discretos, además de observarse que el precio de la opción obtenido con este modelo es una aproximación al precio que se obtiene con el modelo de Black Scholes, el cual es un modelo de cobertura que protege al inversionista.