

Presentación*

Esta edición de ODEON (revista de finanzas) titulada: “Una mirada a algunos problemas financieros y económicos relevantes”, presenta cinco artículos que buscan generar aportes alrededor de una serie de problemas importantes dentro de la economía y las finanzas, a partir de preguntas, posturas, modelos y alternativas.

En el primer artículo, “Milton Friedman y la contrarrevolución keynesiana”, escrito por Luis Armando Blanco y Julián Libreros, se analizan algunos aspectos fundamentales de la contrarrevolución keynesiana que realizó Milton Friedman en la década de los setenta, considerando la economía monetarista, la crítica a la curva de Phillips, la política monetaria y su explicación sobre los determinantes de las crisis económicas, especialmente el Gran Crac de 1929, para contrastarlo con la crisis de 2008.

El segundo artículo, “A CVA approach for financial institutions in Colombia”, escrito por Andrés Felipe Páez Montaña, explica los componentes del ajuste a la valoración por riesgo de crédito (CVA, por sus siglas en inglés) a partir de modelos teóricos, y presenta algunas ideas para su implementación por parte de instituciones financieras en Colombia utilizando herramientas informáticas comunes.

El tercer artículo, “Dinámica de portafolios y control óptimo estocástico”, escrito por John Freddy Moreno Trujillo, presenta una introducción a la teoría de control óptimo estocástico y sus aplicaciones en el marco del problema de selección óptima de portafolios.

En el cuarto artículo, “Análisis de montos y tasas del mercado de simultáneas en Colombia”, escrito por Valeria Roberto Vargas y Kimberly Rojas Silva, se identifica si el mercado de simultáneas, además de reflejar las condiciones de liquidez en pesos, ofrece información sobre las expectativas de desvalorizaciones de los bonos soberanos mediante la clasificación de cada operación en tres rangos, que se construyen a partir del promedio y la desviación estándar del margen.

El último artículo, “Valoración analítica de opciones asiáticas aritméticas continuas mediante transformadas de Fourier”, escrito por Diana Lorena Guavita

* DOI: <https://doi.org/10.18601/17941113.n17.01>

Forero y John Freddy Moreno Trujillo, presenta la deducción de la ecuación diferencial parcial de segundo orden asociada al problema de valoración de opciones asiáticas aritméticas continuas, junto con la aplicación de la transformada de Fourier sobre los términos de la ecuación resultante después de una serie de cambios de variable. De esta manera, se obtiene una solución analítica para el valor de este tipo de opciones.

Para el Observatorio de Economía y Operaciones Numéricas es un gran orgullo producir el número 17 de esta revista, con artículos de buena calidad y alto nivel. Que sea esta una invitación a los estudiosos de las finanzas para buscar nuevas herramientas y nuevos saberes a fin de profundizar en la comprensión de la teoría y los retos de las finanzas modernas.

JOHN FREDDY MORENO TRUJILLO
Coordinador Observatorio de Economía y Operaciones Numéricas
Editor de ODEON (revista de finanzas)