

Seminarium magisterskie: Wycena instrumentów finansowych

(Wolne 4 miejsca)

Prof. UG dr hab. Henryk Leszczyński

Treści programowe

1. Teoria arbitrażu.
2. Modele rynku zupełnego.
3. Relacja preferencji.
4. Optymalność i równowaga.
5. Monetarne miary ryzyka.
6. Dynamiczna teoria arbitrażu.
7. Opcje europejskie.
8. Strategie zatrzymania dla kupującego i sprzedającego.
9. Obwiednia Snella.
10. Ceny wolne od arbitrażu.

Wykaz literatury

1. H. Föllmer, A. Schied "Stochastic Finance. An Introduction in Discrete Time", DeGruyter, 2011.
2. S. R. Pliska "Wprowadzenie do matematyki finansowej Modele z czasem dyskretnym" WNT2005.
3. P. J. Hunt, J. E. Kennedy, "Financial derivatives in theory and practice" Wiley 2004.
4. J. Jakubowski et al, "Matematyka finansowa. Instrumenty pochodne", WNT 2003.