

Wycena instrumentów finansowych.

Seminarium magisterskie – prowadzący Prof. UG, dr hab. Henryk Leszczyński
(Kontynuacja 8 miejsc wolnych)

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.
11. Optymalne zatrzymanie.

Literatura:

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.
5. B. Oksendal, A. Sulem, "Applied Stochastic Control of Jump Diffusion", Springer 2007.