

Obliczenia instrumentów finansowych.

Prof. UG dr hab. Henryk Leszczyński

Wykład monograficzny dla matematyki finansowej.

30 w + 30 c semestr zimowy (ale może być letni!)

1. Wypukłość.
2. Absolutnie ciągłe miary probabilistyczne.
3. Funkcje kwantylowe.
4. Istotne supremum rodziny zmiennych losowych.
5. Przestrzenie miar.
6. Elementy analizy funkcjonalnej.
7. Obwiednia Snella.
8. Zabezpieczenie przy braku arbitrażu.
9. Wielowymiarowy model Hestona.
10. Wypłaty końcowe.
11. Zastosowanie metod przybliżonych.

Literatura.

[1] Follmer, Schied „Stochastic Finance”

[2] Platen, Bruti-Liberati „Numerical Solutions of SDE with Jumps in Finance”.