

Obliczenia instrumentów finansowych.

Prof. UG, dr hab. Henryk Leszczyński

Dodatkowy wykład fakultatywny (semestr zimowy) 30w+30c

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”.
- [3] Jakubowski, Palczewski, Rutkowski, Stettner "Matematyka finansowa. Instrumenty pochodne."
- [4] Pliska "Wprowadzenie do matematyki finansowej" WNT 2005