

Математична теорія фінансових ринків

Мета: формування цілісної системи уявлень про фінансові ринки, теоретико-ймовірнісні методи фінансового моделювання, оцінювання та хеджування платіжних зобов'язань, прийняття оптимальних інвестиційних рішень, управління портфелем

Предмет: теорія арбітражного оцінювання, еквівалентні мартингальні міри, моделі фінансових ринків з дискретним та неперервним часом, хеджування та оцінювання платіжних зобов'язань, теорія середньо-квадратичного хеджування, методи портфельної оптимізації, оптимальні стратегії на фінансових ринках.

Кількість кредитів: 4

Форма контролю: іспит

Викладач: Шевченко Г.М., д.ф.-м.н., доцент.

Змістові модулі:

- фінансові ринки та інструменти;
- фінансові ринки з дискретним часом;
- фінансові ринки з неперервним часом;
- оптимальні рішення на фінансових ринках

Місце у структурно-логічній схемі дисциплін: ДВА.03.01 викладається на II році навчання.