

Wycena arbitrażowa instrumentów pochodnych

Wymagania wstępne: (oprócz podstawowych kursów ze studiów I stopnia) brak

Formuła nauczania: wykład 30 godzin, ćwiczenia 30 godzin

Metoda oceny/forma zaliczenia przedmiotu: egzamin pisemny i ustny

Język wykładowy: polski, angielski

Prowadzący: Armen Edigarian

Treści kształcenia:

Rynki skończone, I i II fundamentalne twierdzenia arbitrażowe, model dwumianowy (CRR), aproksymacja wzoru Blacka-Scholesa, obwódnia Snella, rozkład Dooba, opcje europejskie i amerykańskie.

Zalecana literatura:

1. M. Rutkowski, *Introduction to arbitrage pricing of financial derivatives* (lecture notes).
2. M. Musiela, M. Rutkowski, *Martingale Methods in Financial Modelling*, Springer-Verlag, 1997.