

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ РЕСПУБЛИКИ БЕЛАРУСЬ
БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ФАКУЛЬТЕТ ПРИКЛАДНОЙ МАТЕМАТИКИ И ИНФОРМАТИКИ
Кафедра теории вероятностей и математической статистики

Аннотация к дипломной работе

Расчеты опционов на полных и неполных рынках

Кухарчик Александр Андреевич

Научный руководитель – кандидат физико-математических наук, доцент
Зуев Н.М.

Минск, 2022

Реферат

Дипломная работа, 51 страница, 4 источника, 2 таблицы, одно приложение.

Ключевые слова: ОПЦИОН, МАРТИНГАЛ, АРБИТРАЖ, НЕПОЛНЫЙ РЫНОК, ПОЛНЫЙ РЫНОК, СТОИМОСТЬ ОПЦИОНА.

Объектом исследования выступает опцион.

Предметом дипломной работы являются опционы европейского типа на неполных рынках.

Целью работы является расчёт стоимости опциона на неполных рынках.

В работе использовались методы финансовой математики и теории вероятностей, а также методы статистического моделирования.

Результатом являются формулы и методы расчёта стоимости опциона.

Областью применения являются финансовые рынки.

Abstract

Degree paper, 51 pages, 4 sources, 2 tables, one appendix.

Keywords: OPTION, MARTINGALE, ARBITRAGE, INCOMPLETE MARKET, OPTION VALUE.

The object of the study is an option.

The subject of the thesis is options of the European type in incomplete markets.

The purpose of the work is to calculate the value of an option in incomplete markets.

Methods of financial mathematics and probability theory, as well as methods of statistical modeling were used in the work.

The result is formulas and methods for calculating the value of the option.

The scope of application is financial markets.