NY KURS I FINANSIELL MATEMATIK

Den nya kursen "Optioner och matematik" startar måndagen den 12 mars 2001, kl 10.00, i sal MD6 (Matematiskt Centrum).

Kursen inleds med ett avsnitt om portföljdominans och behandlar därefter den så kallade binomialmodellen, som i gräns ger Black-Scholes optionspriser. Resultaten tillämpas dels på köp- och säljoptioner av amerikansk och europeisk typ dels på en del exotiska och valutaberoende finansiella derivat. Kursen behandlar även aktiederivat då aktien ger utdelning. Kunskaper i linjär algebra, flerdimensionell analys och sannolikhetsteori är lämpliga förkunskaper. Kursen "Optioner och matematik" ger i sin tur bra förkunskaper för kursen "Finansiella derivat och stokastisk analys" i period 2.

Välkomna!

Göteborg 16 februari 2001

Christer Borell

PS: Lektion 2: tisdagen den 13 mars kl 13.15 i sal MD6; lektion 3: fredagen den 16 mars kl 10.00 i sal MD6. DS