

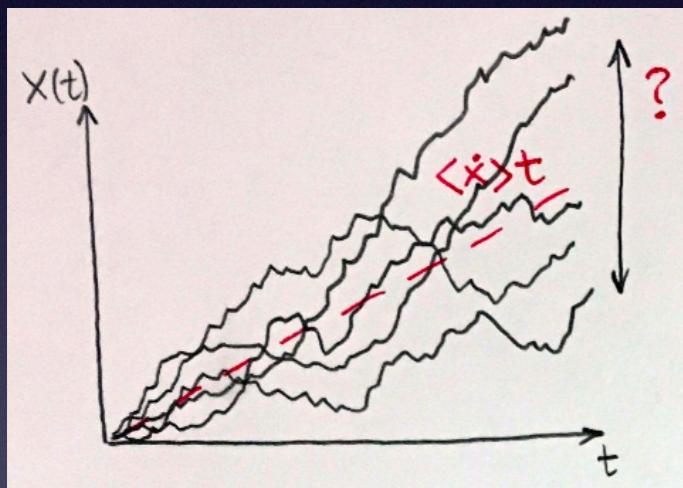
Случайное блуждание

Мат модель объединила физику и экономику

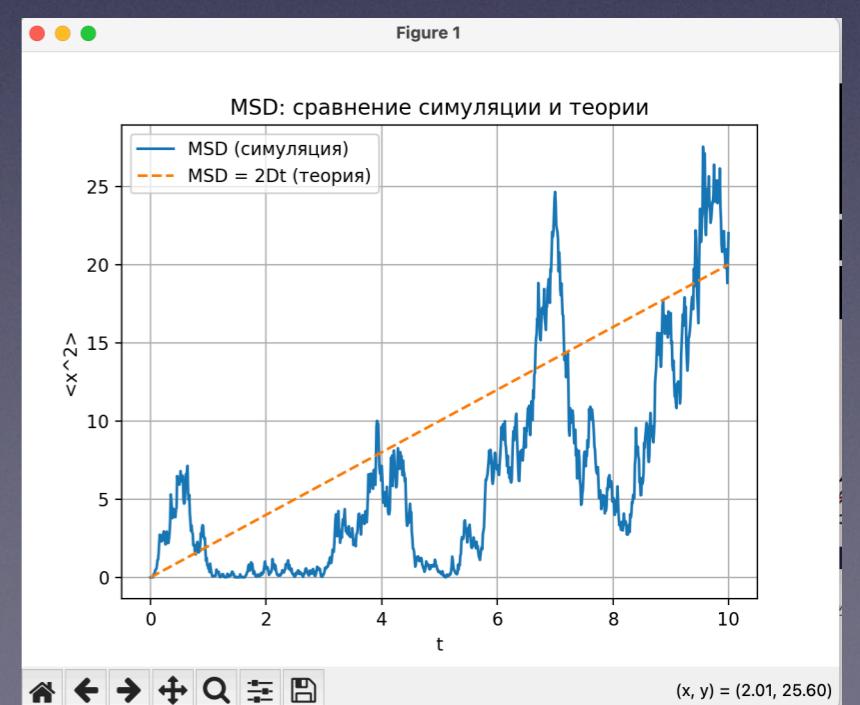
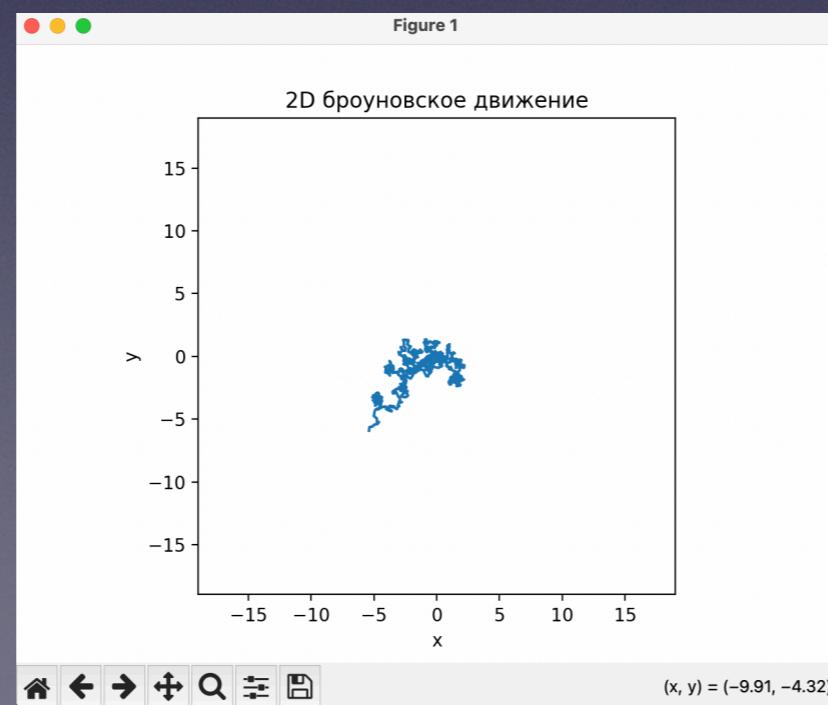
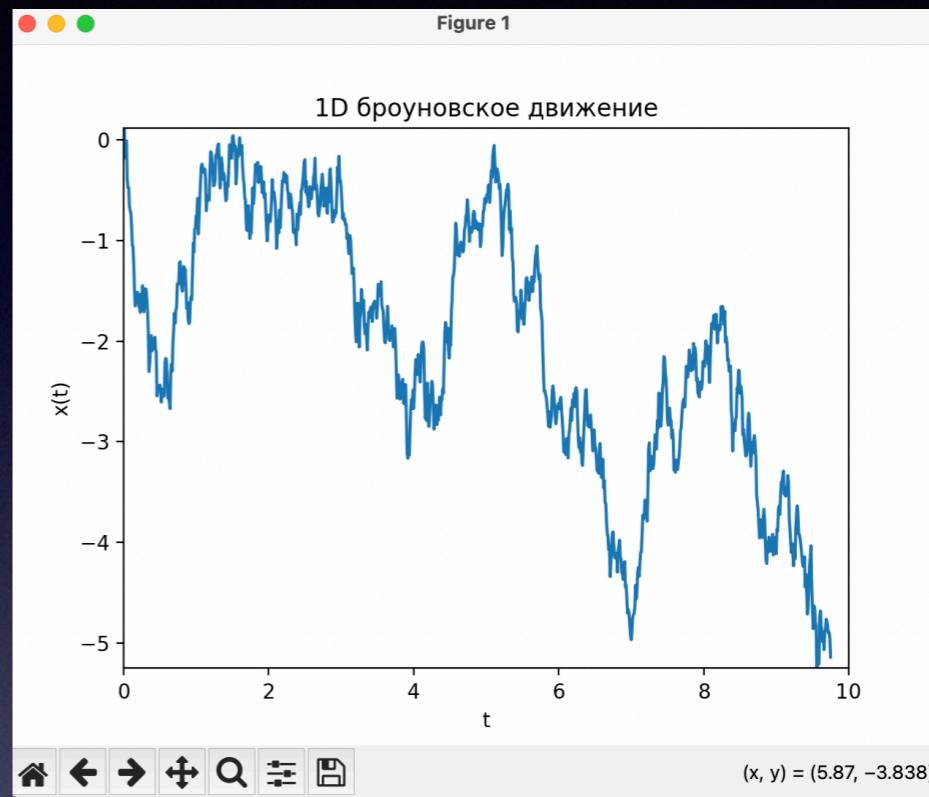
Броуновское движение

Броуновское движение — хаотическое движение частиц, вызванное ударами молекул среды.

- $x(t+\Delta t) = x(t) + (2D\Delta t)^{0.5} N(0,1)$
- $x[i+1] = x[i] + \sigma * np.random.randn()$



MSD показывает, как быстро частица в среднем “разбегается” от точки старта.



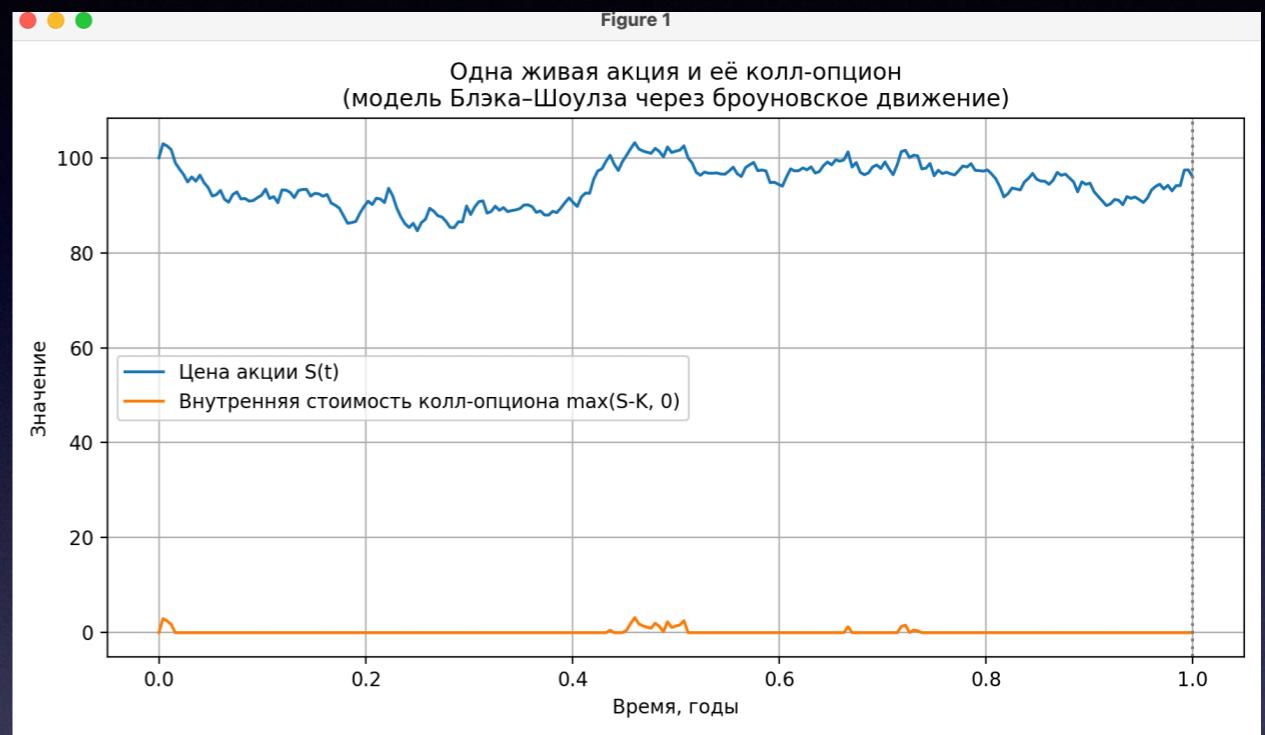
Модель Блэка Шоулза

$$C = S_0 N(d_1) - K e^{-rT} N(d_2),$$

K - strike price

R - free risk rate

$N(\cdot)$ distribution function





Репозиторий, куда будут
выкладываться обновления