

Процессы Леви и финансовая математика

Осень 2025

Лимар Иван Александрович
ivan.limar95@gmail.com

Содержание

В курсе рассматриваются финансовые модели и связанные с ними случайные процессы: мартингалы, модели временных рядов, стохастические дифференциальные уравнения и процессы Ито, процессы Леви, модель Блэка — Шоулза и другие.

Организационные моменты

Отличиться можно следующими способами:

- Решение задач у доски
- Доклад по предложенной теме
- Мини-проект – более-менее содержательная задача, при решении которой применены модели финансовой математики, с представлением на мини-конференции
- Собесеживание на экзамене

Особо отличившиеся могут рассчитывать на положительную оценку без собеседования на экзамене

Список источников

- [1] Baxter. *Financial Calculus An Introduction to Derivative Pricing*.
- [2] Shreve, *Stochastic calculus for finance*
- [3] Ширяев, *Основы стохастической финансовой математики*.
- [4] Оскендаль. Стохастические дифференциальные уравнения.
- [5] Hull. Options, Futures and Other Derivatives

Это далеко не исчерпывающий список литературы и можно его уточнять в зависимости от конкретных интересов и запросов.