

Εργασίες στα Χρηματοοικονομικά

Επιλέξτε ένα απο τα παρακάτω θέματα. Στην παρένθεση δίνεται ενδεικτική βιβλιογραφία αλλά προσπαθείστε να ψάξετε και μόνοι σας.

1. Προσομοίωση απο στοχαστικές διαφορικές εξισώσεις και εφαρμογές στην αποτίμηση παραγώγων προϊόντων (Kloeden and Platen Numerical Solution of Stochastic Differential Equations)
2. Μοντέλοποίηση των συσχετίσεων με την χρήση copulas και εφαρμογές στην διαχείριση κινδύνου (Schied, Frey and Embrechts, Quantitative Risk Management)
3. Μοντέλα χρονολογικών σειρών στα χρηματοοικονομικά (Schied, Frey and Embrechts, Quantitative Risk Management)
4. Μέθοδοι μηχανικής μάθησης στα χρηματοοικονομικά (Dixon, Halperin, Bilokon, Machine learning in finance, Theory and practice)
5. Μέθοδοι αποτίμησης πιστωτικού κινδύνου (Measuring and managing credit risk, Servigny and Renault)
6. Μέτρα κινδύνου πέρα απο το VaR (Schied, Frey and Embrechts, Quantitative Risk Management)