

BLACK-SCHOLES-MERTON MODEL

ANEJ ROZMAN

Fakulteta za matematiko in fiziko
Univerza v Ljubljani

V članku so predstavljene evropske opcije,

BLACK-SCHOLES-MERTON MODEL

1. Uvod

V članku bomo matematično izpeljali Black-Scholes-Mertonov model, ki je osnova za določanje cene opcij. Najprej bomo predstavili osnovne pojme, ki jih potrebujemo za razumevanje modela. Nato bomo izpeljali model in ga na koncu še numerično rešili.

2. Poglavlje

LITERATURA

- [1] E.A. Cornell, C.E. Wieman, M.R. Matthews, J.R. Ensher in M.H. Anderson, *Observation of Bose-Einstein Condensation in a Dilute Atomic Vapor*, Science **269** (1995), 198–201.
- [2] W. Ketterle, D.M. Kurn, D.S. Durfee, N.J. van Druten, M.R. Andrews, M.-O. Mewes in K.B. Davis, *Bose-Einstein Condensation in a Gas of Sodium Atoms*, Physics Review Letters **75** (1995), 3969–3973.