

История появления опционных контрактов. Решение задачи о справедливой цене опциона со времен античности до наших времен

Смирнова Вера Андреевна

Санкт-Петербургский Государственный Электротехнический Университет

vera-sm@yandex.ru

Секция: История математики

1. Появление опционов (античные времена). Использование их математиком Фалесом.
2. Средние века. Опционные контракты для голландских торговцев тюльпанами.
3. Деятнадцатый век. Кризис торговли опционами.
4. Двадцатый век. Создание фондовых бирж и плавающего валютного курса.
Задача о справедливой цене опциона превращается в корректно поставленную математическую.
5. Современное состояние задачи о вычислении справедливой цены опциона и ее связь с развитием теории случайных процессов.