

Список вопросов по курсу
"Элементы финансовой математики"
2009 г
(II часть).

1. Введение в финансовые рынки и риск-менеджмент.
2. Теория ожидаемой полезности.
3. Функции полезности на прямой, формализация отношения к риску.
4. Интерпретация теории ожидаемой полезности.
5. Функция полезности для задачи оптимального инвестирования, независимость по предпочтениям.
6. Стохастическое доминирование.
7. Задача оптимального хеджирования для опциона американского типа: функция полезности, постановка задачи.
8. Задача оптимального гарантированного хеджирования для опциона американского типа: детерминистская постановка, уравнение Беллмана.
9. Задача оптимального гарантированного хеджирования для опциона американского типа: 1-я теорема финансовой математики.