

# Опционы и Математика

Ваня Воробьев

[t.me/v0r0bi0v](https://t.me/v0r0bi0v) | +79779996957 | [IEVorobyev@sberbank.ru](mailto:IEVorobyev@sberbank.ru)

24 июля 2024 г.

# Базовые понятия

## Случайная величина

# Базовые понятия

## Случайная величина

- ▶ *Математическое ожидание*

$$\mathbb{E}(\xi) = \int_{-\infty}^{+\infty} x f_{\xi}(x) dx$$

- ▶ *Дисперсия*

$$\mathbb{D}(\xi) = \mathbb{E}((\xi - \mathbb{E}\xi)^2) \left( = \sum_{i \in I} x_i \cdot \mathbb{P}(\xi = x_i) \right)$$

# Что такое опцион



# Что такое опцион

- ▶ Валюта
- ▶ Товары
- ▶ Ценные бумаги
- ▶ Процентная ставка
- ▶ Что угодно численное

# Производный финансовый инструмент