

# Pénzügyi folyamatok

tételsor, 2016. ősz

1. Származékos termékek, diszkrét idejű piacok, önfinanszírozó és fedezeti stratégiák.
2. Diszkrét idejű martingálok fontosabb tulajdonságai. Ekvivalens martingálmértékek diszkrét idejű piacokon.
3. Az arbitrázsmentességre és a teljességre vonatkozó főtételek.
4. Befektetési költség. Opcióárazás binomiális piacokon, a CRR-formula. A Put-Call paritás.
5. A Wiener-folyamat és a folytonos idejű martingálok fontosabb tulajdonságai.
6. A sztochasztikus integrál.
7. Az Itô-formula. Példák a formula alkalmazására.
8. A Lévy-féle karakterizációs tétel és a Girsanov-tétel.
9. Folytonos idejű értékpapírpiacok, a Black–Scholes-modell.
10. Folytonos idejű Markov-folyamatok, Kolmogorov egyenletei.