



ABSTRAKT

Wybrane zagadnienia matematyki finansowej

Łukasz Stettner, prof. dr hab.

Instytut Matematyczny PAN

Przedmiotem wykładu jest przegląd różnych zagadnień matematyki finansowej z potencjalnymi zastosowaniami. Od zagadnień prostych związanych z oprocentowaniem, zmiennością pieniądza w czasie, przechodzimy do modeli stopy procentowej i jej charakterystyk. Przedstawione ponadto będą elementy analizy portfelowej zarówno statycznej (teoria Markowitza) jak i dynamicznej (głównie w czasie dyskretnym). Rozważone będą kwestie braku arbitrażu i wyceny instrumentów pochodnych. Specjalną uwagę poświęcimy problemowi ryzyka: modelowaniu i jego pomiarowi. Celem wykładu jest zainteresowanie słuchaczy tematyką co może w przyszłości zaowocować dalszemu poszerzaniu wiedzy w celu uzyskania specjalizacji z matematyki finansowej czy też aktuarialnej.