

ИМИ 1.1.

Тема: 1.1.27. ФИНАНСОВИ МОДЕЛИ НА ОСНОВАТА НА СКОКОВИ ПРОЦЕСИ

FINANCIAL MODELS BASED ON JUMP PROCESSES

Лектор: доц. д-р Цветелин Заевски

Assoc. Prof. PhD Tsvetelin Zaevski

E-mail: t_s_zaeovski@math.bas.bg

Тел.: 02/ 979 38 46

Хорариум: 30 часа лекции

Анотация:

Курсът има за цел да разшири познанията на докторантите в областта на процесите на Леви и тяхното приложение към финансовите пазари, особено към дериватите. Предметът на обучение включва Поасонов процес, сложен Поасонов процес, устойчиви процеси и др. Докторантите ще бъдат запознати със симулациите и техните особености. Ще бъде обърнато внимание на моделите със стохастична волатилност.

Abstract:

The course aims to expand the knowledge of PhD students in the field of Levy processes and their applications to financial markets, especially to the financial derivatives. The subject of the course includes Poisson processes, compound Poisson processes, stable processes, etc. PhD students will be introduced to simulations and their features. Attention will be paid to models with stochastic volatility.

Необходими предварителни знания:

Начални познания по теория на вероятностите, математическа статистика и случайни процеси.

Required prior knowledge:

Basic knowledge on the probability theory, mathematical statistics, and stochastic processes

Компетентности, придобити в резултат на обучението:

Курсът дава подготовка по моделиране на финасови активи и деривати както чрез непрекъснати, така и със скокови процеси.

Competencies acquired as a result of the course:

The course provides a knowledge on modeling of financial assets and derivatives through both continuous and jump processes.