



تاریخ:

شماره:

جلسه دفاع از پایان نامه کارشناسی ارشد (یا رساله دکترا)

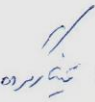
رشته: ریاضی کاربردی - ریاضی مالی

عنوان پایان نامه یا رساله: قیمت گذاری اختیار معامله های اروپایی در یک مدل پرش-انتشار با تلاطم تصادفی

ارائه دهنده: خانم زهرا جعفری چهل خانه

استادان راهنما: سرکار خانم ندا اسماعیلی ،

استادان مشاور: جناب آقای حسن خسرویان عرب ،

تاریخ: ۱۴۰۲/۰۶/۲۷، ساعت: ۱۰:۰۰-۱۲:۰۰، مکان جلسه: 

نام دانشکده و گروه: ریاضی و آمار ریاضی کاربردی و علوم کامپیوتر

چکیده:

در این پایان نامه، قیمت گذاری اختیار معامله های اروپایی در یک مدل پرش-انتشار همراه با تلاطم تصادفی و هزینه های معاملاتی را مورد مطالعه قرار می دهیم که منجر به دستیابی به یک معادله دیفرانسیل-انتگرال با مشتقات جزئی غیرخطی می شود. همچنین مساله بازسازی اختیار معامله در یک چارچوب زمان-گسسته با هزینه های معاملاتی و قیمت گذاری اختیار معامله در چنین بازار ناکاملی را مورد بررسی قرار می دهیم. در ادامه با مشاهده و معرفی یی پروکسی معامله شده برای تلاطم در بازار مدرن، یک معادله دیفرانسیل-انتگرالی با مشتقات جزئی غیرخطی را در صورت وجود هزینه های معاملاتی بدست می آوریم. در نهایت تحت شرایط منظم و مناسب، وجود جواب قوی برای این مساله قیمت گذاری را ثابت می کنیم و سبدمالی خودگردان را مورد بحث قرار می دهیم.