



تاریخ:

شماره:

جلسه دفاع از پایان نامه کارشناسی ارشد (یا رساله دکترا)
رشته: ریاضی کاربردی - ریاضی مالی

عنوان پایان نامه یا رساله: قیمت گذاری اختیارمعاملات وارون و کوانتویی رمزارز

ارائه دهنده: خانم سیده نسترن جعفری

استادان راهنما: سرکار خانم ندا اسماعیلی ،

استادان مشاور: ،

تاریخ: ۱۴۰۳/۰۶/۲۷، ساعت: ۱۰:۰۰-۱۲:۰۰، مکان: جلسه: ساختمان ریاضی و آمار ساختمان ریاضی و آمار طبقه دوم -

سمینار سه ریاضی

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

چکیده: در این پایان نامه، پس از آشنایی با دنیای رمزارزها، وضعیت فعلی بازار اختیارمعاملات رمزارز مورد بررسی قرار می گیرد. پس از آن با چهار نوع

از اختیارمعاملات در این محیط آشنا می شویم و آن ها را با یکدیگر مقایسه خواهیم کرد. سپس با استفاده از مدل بلک-شولز، به قیمت گذاری

اختیارمعاملات وارون و وارون کوانتویی می پردازیم و با استفاده از نتایجی که از قیمت گذاری حاصل می شود، مشخص خواهیم کرد که تحت چه شرایطی

استفاده از کدام اختیارمعامله مقرون به صرفه تر می باشد، هم چنین در نهایت به محاسبه ی نسبت های پوشش ریسک با استفاده از توابع قیمت بدست آمده،

خواهیم پرداخت.