

Uogólnienie ceny arbitrażowej

Wstęp..... 1

Rozdział 1

Podstawowe pojęcia

1.1 Przestrzeń probabilistyczna 2

1.2 Skończona przestrzeń probabilistyczna 5

1.3 Elementy analizy stochastycznej 7

Rozdział 2

Rynki skończone

2.1 Model rynku jedookresowego 10

2.2 Model rynku wielookresowego 19

Rozdział 3

Wycena instrumentu finansowego

3.1 Instrumenty osiągalne i nieosiągalne 25

3.2 Cena kupującego i sprzedającego oraz uogólniona cena arbitrażowa 30

Zakończenie33

Bibliografia34