

Содержание

Введение	4
----------------	---

ЧАСТЬ 1. НЕКОТОРЫЕ ГЛАВЫ АНАЛИЗА

1 Неравенство Коши – Буняковского	6
2 Теорема Вейерштрасса о приближении полиномами	9
3 Тригонометрическая теорема Вейерштрасса	13
4 Теорема Бернулли «в схеме серий»	14
5 Теорема де Муавра – Лапласа «в схеме серий»	16
6 Экспоненциальные оценки в теореме де Муавра – Лапласа ...	22

ЧАСТЬ 2. ПРИЛОЖЕНИЕ К ФИНАНСОВОЙ МАТЕМАТИКЕ

7 Одношаговая биномиальная модель рынка	25
7.1 Введение	25
7.2 Простейший пример портфеля	29
7.3 Эквивалентный портфель, арбитраж	30
7.4 Цена опциона колл в одношаговой модели	31
7.5 Другое представление решения	33
7.6 Пример	35
7.7 Общий (европейский) опцион и его цена	38
8 Двухшаговая модель	39
8.1 Двухшаговая модель: общий случай	39
8.2 Однородная двухшаговая модель	45
8.3 Пример	47
9 Многошаговая биномиальная модель	49
10 Предельный переход в однородной многошаговой модели	50
11 Формула Блэка – Шоулса	55
Литература	59