

Universiteit van Pretoria Jaarboek 2018

Wiskundige modelle van finansiële ingenieurswese 732 (WTW 732)

Kwalifikasie	Nagraads
Fakulteit	Fakulteit Natuur- en Landbouwetenskappe
Modulekrediete	15.00
Programme	BScHons Finansiële Ingenieurswese BScHons Wiskunde van Finansies
Voorvereistes	Geen voorvereistes.
Kontaktyd	2 lesings per week
Onderrigtaal	Module word in Engels aangebied
Departement	Wiskunde en Toegepaste Wiskunde
Aanbiedingstydperk	Semester 1

Module-inhoud

*Hierdie inligting is slegs in Engels beskikbaar.

Introduction to markets and instruments. Futures and options trading strategies, exotic options, arbitrage relationships, binomial option pricing method, mean variance hedging, volatility and the Greeks, volatility smiles, Black-Scholes PDE and solutions, derivative disasters.

Die inligting wat hier verskyn, is onderhewig aan verandering en kan na die publikasie van hierdie inligting gewysig word.. Die [Algemene Regulasies \(G Regulasies\)](#) is op alle fakulteite van die Universiteit van Pretoria van toepassing. Dit word vereis dat elke student volkome vertrouwd met hierdie regulasies sowel as met die inligting vervat in die [Algemene Reëls](#) sal wees. Onkunde betreffende hierdie regulasies en reëls sal nie as 'n verskoning by oortreding daarvan aangebied kan word nie.