

Universiteit van Pretoria Jaarboek 2018

Wiskundige modelle van finansiële ingenieurswese 762 (WTW 762)

Kwalifikasie	Nagraads
Fakulteit	Fakulteit Natuur- en Landbouwetenskappe
Modulekrediete	15.00
Programme	BScHons Finansiële Ingenieurswese BScHons Wiskunde van Finansies
Voorvereistes	WTW 732 of WTW 364
Kontaktyd	2 lesings per week
Onderrigtaal	Module word in Engels aangebied
Departement	Wiskunde en Toegepaste Wiskunde
Aanbiedingstydperk	Semester 2

Module-inhoud

*Hierdie inligting is slegs in Engels beskikbaar.

Exotic options, arbitrage relationships, Black-Scholes PDE and solutions, hedging and the Miller-Modigliani theory, static hedging, numerical methods, interest rate derivatives, BDT model, Vasicek and Hull-White models, complete markets, stochastic differential equations, equivalent Martingale measures.

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. Onkonde betreffende hierdie regulasies en reëls sal nie as 'n verskoning by oortreding daarvan aangebied kan word nie.