

№1 Найти матрицу и
тепло сбалансированного
раста в простейшей
динамической модели
Лотка-Вольтерра с матрицей

$$A = \begin{pmatrix} 0.2 & 0.1 \\ 1 & 0 \end{pmatrix}$$

№2 Найти греческий
показатель $\rho_0(p)$ для
опциона на продажу
с платежной функцией

$$f(s_1) = (K - s_1)_+$$

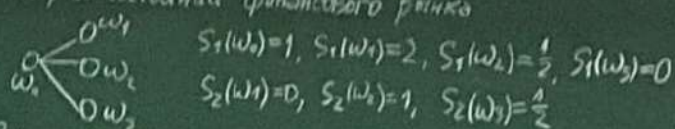
в модели Блэка-Шоулса

№3

сущес-
(р) для
покуп-
функции
+
а-шораса

В3 Оцените эффект рынка для покупателя
по покупке (платёжная функция $f(s) = (s - K)_+$)
со сроком погашения $(y_1(s, t))$, т.е. $\frac{\partial y_1(s, t)}{\partial s_1}$

В4 Пусть цена безрискового актива постоянна
и имеется два типа акций.
Дерево состояний финансового рынка



В каком интервале должна находиться цена $S_2(\omega_0)$,
чтобы финансовый рынок был дезарбитражен?

