



## **Миникурс лаборатории Чебышева**



**Евгений Лакштанов (Университет Авейру, Португалия)**

### **Введение в Quantitative Finance**

**первая лекция: чт. 24 октября, 18:45-20:15,  
аудитория 105 (14-я линия В. О. 29)**

Данный курс будет интересен желающим сделать первые шаги в серьезной финансовой математике. Акцент будет сделан на идейном содержании математических моделей, то есть необходимые математические инструменты будут вводиться по мере их востребованности. Мы разберем следующие модели: Options Pricing and Bonds in Black-Scholes, Heston, Vasicek, HJM and Libor Market models. С технической точки зрения мы разберем применение на практике интегралов и процессов Ито, дискретизации и моделирования стохастических дифференциальных уравнений. При наличии времени также будут обсуждаться темы автоматического дифференцирования, методы калибровки и машинного обучения.

Минимальные требования: стандартные курсы анализа, дифференциальных уравнений и теории вероятности.

Приглашаются все желающие!